

ABSTRAK

ANALISIS PENGARUH *EARNING PER SHARE* (EPS), *RETURN ON EQUITY* (ROE) DAN *DEBT TO EQUITY RATIO* (DER) TERHADAP *RETURN SAHAM*

(Penelitian pada Perusahaan yang *Listing* di *Jakarta Islamic Index* (JII) Periode 2008-2011)

Tujuan penelitian ini adalah untuk mengetahui bagaimana *Earning Per Share* (EPS), *Return On Equity* (ROE), *Debt to Equity Ratio* (DER) dan *Return* saham, untuk mengetahui apakah terdapat pengaruh *Earning Per Share* (EPS), *Return On Equity* (ROE) dan *Debt to Equity Ratio* (DER) terhadap *Return* saham secara parsial dan secara simultan pada perusahaan yang *listing* di *Jakarta Islamic Index* (JII) periode 2008-2011.

Jenis penelitian ini adalah deskriptif verifikatif bersifat kausal dan merupakan uji statistik deskriptif. Penelitian ini menggunakan *nonprobability sampling*. Jenis data yang digunakan pada penelitian ini adalah data kuantitatif yang merupakan data sekunder, yaitu laporan keuangan tahunan 2008-2011 pada perusahaan yang *listing* di *Jakarta Islamic Index* (JII) periode 2008-2011, sebanyak 10 perusahaan. Untuk mengolah data dan menarik kesimpulan, penulis menggunakan metode analisis regresi berganda dengan tingkat signifikansi 5%.

Hasil penelitian secara parsial menunjukkan bahwa hanya *Earning Per Share* (EPS) yang memiliki pengaruh yang signifikan dengan arah hubungan positif terhadap *Return* saham. Sedangkan *Return On Equity* (ROE) dan *Debt to Equity Ratio* (DER) tidak berpengaruh signifikan terhadap *Return* saham. Hasil penelitian secara simultan menunjukkan bahwa *Earning Per Share* (EPS), *Return On Equity* (ROE) dan *Debt to Equity Ratio* (DER) terdapat pengaruh secara simultan terhadap *Return* Saham pada perusahaan yang *listing* di *Jakarta Islamic Index* (JII) periode 2008-2011, dengan nilai koefisien determinasi sebesar 41,4%.

Kata Kunci : *Earning Per Share* (EPS), *Return On Equity* (ROE), *Debt To Equity Ratio* (DER) dan *Return* Saham