

ABSTRAK

Skripsi dengan judul “Pengaruh *Earning Per Share*, *Debt to Equity Ratio* dan *Return On Equity* terhadap *Return Saham* Perusahaan yang Terdaftar dalam Daftar Efek Syariah”, ini ditulis oleh Feni Yuliana, NIM. 12406183189 jurusan Manajemen Keuangan Syariah, dengan pembimbing Prof. Dr. Agus Eko Sujianto, S.E., M.M.

Investor akan tertarik pada perusahaan yang memberikan *return* yang relatif tinggi. Sebelum memutuskan untuk berinvestasi pada suatu perusahaan, investor perlu melakukan penilaian terhadap prospek perusahaan dengan cara melakukan analisis laporan keuangan. Terdapat banyak faktor yang mempengaruhi *return* saham diantaranya adalah *Earning Per Share*, *Debt to Equity Ratio* dan *Return On Equity* dan rasio keuangan lainnya.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui ada atau tidaknya pengaruh yang signifikan antara variabel *Earning Per Share*, *Debt to Equity Ratio* dan *Return On Equity* terhadap *return* saham perusahaan yang terdaftar dalam Daftar Efek Syariah. Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif dengan jenis penelitian asosiatif. Pengambilan sampel menggunakan teknik *purposive sampling* dengan jumlah sampel 10 perusahaan yang terdaftar dalam Daftar Efek Syariah. Teknik analisis data menggunakan analisis regresi data panel, uji asumsi klasik, uji hipotesis dan uji koefisien determinasi.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial (1) *Earning Per Share* berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *return* saham (2) *Debt to Equity Ratio* berpengaruh negatif dan tidak signifikan terhadap *return* saham (3) *Return On Equity* berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham; dan kemudian secara simultan (4) *Earning Per Share*, *Debt to Equity Ratio* dan *Return On Equity* berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham perusahaan yang terdaftar dalam Daftar Efek Syariah.

Kata Kunci: *Earning Per Share*, *Debt to Equity Ratio*, *Return On Equity*, *Return Saham*

ABSTRACT

The thesis entitled " The thesis with the title "The Effect of Earnings Per Share, Debt to Equity Ratio and Return On Equity on The Return on Shares of Companies Listed in the Sharia Securities List", was written by Feni Yuliana, NIM. 12406183189 majoring in Islamic Financial Management, with the supervisor Prof. Dr. Agus Eko Sujianto, S.E., M.M.

Investors will be interested in companies that provide relatively high returns. Before deciding to invest in a company, investors need to make an assessment of the prospects of the company by conducting an analysis of financial statements. There are many factors that affect stock returns including Earnings Per Share, Debt to Equity Ratio and Return On Equity and other financial ratios.

This study aims to determine whether or not there is a significant influence between the variables Earning Per Share, Debt to Equity Ratio and Return On Equity on the return on shares of companies listed in the Sharia Securities List. This research uses a quantitative approach with an associative type of research. Sampling using purposive sampling technique with a sample of 10 companies listed in the list of Sharia Securities. Data analysis techniques use panel data regression analysis, classical assumption test, hypothesis test and determination coefficient test.

The results of this study show that partially (1) Earnings Per Share have a negative and insignificant effect on stock returns (2) Debt to Equity Ratio has a negative and insignificant effect on stock returns (3) Return On Equity has a positive and significant effect on stock returns; and then simultaneously (4) Earnings Per Share, Debt to Equity Ratio and Return On Equity have a positive and significant effect on the return on shares of companies listed in the Sharia Securities List.

Keywords: *Earning Per Share, Debt to Equity Ratio, Return On Equity, Stock Return*