

ABSTRAK

YULITA NORMA SARI. 2020. Analisis Pengaruh *Price Book Value* (PBV), *Debt To Equity Ratio* (DER), *Return On Equity* (ROE) dan *Earning Per Share* (EPS) Terhadap *Return Saham* Pada Perusahaan-Perusahaan Dalam Jakarta Islamic Index (JII) Periode Tahun 2015-2018. Skripsi, Jurusan Ekonomi Syariah. Pembimbing: (I) Dr. Zaki Mubarak, S.E, M.Si. (II) Erissa Nilasari, S.P.,M.P.

Kata Kunci : *Price Book Value* (PBV), *Debt To Equity Ratio* (DER), *Return On Equity* (ROE) dan *Earning Per Share* (EPS).

Penelitian ini dilakukan untuk memberikan gambaran kepada para investor terkait return saham dan beberapa ratio dalam melakukan analisis secara fundamental pada perusahaan-perusahaan yang termasuk dalam index JII, mengingat pentingnya *return* saham bagi investor untuk menentukan apakah investor akan menanamkan sahamnya pada perusahaan yang bersangkutan atau tidak.

Adapun tujuan dalam penelitian ini adalah untuk menguji dan menganalisis Pengaruh *Price Book Value* (PBV), *Debt To Equity Ratio* (DER), *Return On Equity* (ROE) dan *Earning Per Share* (EPS) Terhadap *Return Saham* Pada Perusahaan-Perusahaan Dalam Jakarta Islamic Index (JII) periode tahun 2015-2018.

Sampel penelitian terdiri dari 14 Perusahaan dengan jumlah pengamatan sebanyak 56 data pengamatan. Metode pengambilan sampel dilakukan dengan menggunakan *purposive sampling*. Metode pengujian hipotesis yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda.

Hasil penelitian ini baik secara parsial maupun secara simultan variabel *Price Book Value* (PBV), *Debt To Equity Ratio* (DER), *Return On Equity* (ROE) dan *Earning Per Share* (EPS) tidak berpengaruh secara positif terhadap *return* saham.