

ABSTRAKSI

Pasar modal dapat dikatakan sebagai indikator kemajuan perekonomian suatu negara serta menunjang ekonomi negara yang bersangkutan. Keberhasilan suatu perusahaan menjadi ukuran dan perhatian para pemilik modal sebagai dasar pengambilan keputusan untuk berinvestasi agar nantinya bisa mendapatkan tingkat pengembalian seperti yang diinginkan. Sehingga diharapkan perusahaan dapat memberikan informasi keuangan yang lebih akurat dan dapat dipercaya.

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh *Total Asset Turnover* (TATO), *Return On Asset* (ROA), *Return On Equity* (ROE), *Current Ratio* (CR), *Debt to Equity Ratio* (DER), dan *Earning Per Share* (EPS) terhadap *return* saham syariah dalam *Jakarta Islamic Index* (JII) pada Bursa Efek Indonesia (BEI). Teknik sampling yang digunakan adalah metode *purposive sampling*, dengan kriteria perusahaan yang masuk dalam daftar *Jakarta Islamic Index* (JII) dan konsisten listing dari tahun 2011-2013. Data diperoleh berdasarkan publikasi *Indonesian Capital Market Directory* (ICMD). Dan diperoleh jumlah sampel sebanyak 14 perusahaan. Data yang digunakan merupakan data sekunder dan metode analisis yang digunakan adalah analisis regresi linier berganda dengan bantuan program *Statistical Product and Service Solution* (SPSS) versi 16 untuk mengetahui besar kecilnya pengaruh antara variabel satu dengan variabel yang lain.

Hasil penelitian dari uji f menunjukkan bahwa TATO, ROA, ROE, CR, DER, dan EPS secara simultan berpengaruh signifikan terhadap *return* saham syariah. Sedangkan dari hasil uji t menunjukkan bahwa ROA dan EPS mempunyai pengaruh positif yang signifikan terhadap *return* saham syariah, dengan nilai signifikan ROA sebesar 0,016 dan EPS sebesar 0,034. Variabel DER mempunyai pengaruh negatif yang signifikan terhadap *return* saham syariah dengan nilai signifikan sebesar 0,049. Sedangkan variabel TATO, ROE, dan CR tidak berpengaruh signifikan terhadap *return* saham syariah dengan nilai signifikan TATO sebesar 0,051, ROE sebesar 0,813, dan CR nilai signifikannya sebesar 0,288.

Kata kunci : *Return*, Saham Syariah, *Total Asset Turnover* (TATO), *Return On Asset* (ROA), *Return On Equity* (ROE), *Current Ratio* (CR), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Earning Per Share* (EPS).