

ABSTRAK

Penelitian ini dilakukan untuk mengetahui pengaruh *Return On Asset* (ROA), *Return On Equity* (ROE), *Dividend Payout Ratio* (DPR) dan *Price Earning Ratio* (PER) terhadap *Return Saham* terhadap perusahaan yang tergabung di *Jakarta Islamic Index 70* (JII 70) di Bursa Efek Indonesia periode 2018-2019. Jumlah sample 46 perusahaan dari 70 perusahaan yang terdaftar. Teknik *Sampling* yang digunakan adalah *Purposive Sampling*. Metode analisis yang digunakan adalah metode regresi berganda. Uji hipotesis menggunakan t statistik untuk menguji pengaruh variabel secara parsial dan Uji F-statistik untuk menguji variabel secara bersama-sama terhadap *return* saham dengan *level of significance* 0,05. Selain itu dilakukan uji asumsi klasik yang meliputi uji normalitas data, uji multikolonieritas, uji heteroskedastisitas, dan uji autokorelasi. Adapun hasil penelitian yang diperoleh secara simultan *Return On Asset* (ROA), *Return On Equity* (ROE), *Dividend Payout Ratio* (DPR) dan *Price Earning Ratio* (PER) berpengaruh terhadap *Return Saham*. Secara parsial *Return On Asset* (ROA), *Return On Equity* (ROE), dan *Price Earning Ratio* (PER) berpengaruh terhadap *Return Saham*. Sedangkan *Dividend Payout Ratio* (DPR) tidak berpengaruh terhadap *Return Saham*.

Kata Kunci: *Return On Asset* (ROA), *Return On Equity* (ROE), *Dividend Payout Ratio* (DPR), *Price Earning Ratio* (PER), *Return Saham*.

ABSTRACT

This research performed in order to test influence of Return On Asset (ROA), Return On Equity (ROE), Dividend Payout Ratio (DPR) and Price Earning Ratio (PER) on stock return of companies listed on the Jakarta Islamic Index 70 (JII 70) on the Indonesia Stock Exchange for 2018-2019 period. The number of sampling use 46 companies from 70 listed companies. Sampling technique used in the research is purposive sampling. Analysis method used is multiple regression method. Hypotheses test used t-statistic and f-statistic at level significance 0,05. A classic assumption examination which consist of data normality test, multicollinearity test, heteroskedasticity test and autocorrelation test. The research result obtained are simultaneous Return On Asset (ROA), Return On Equity (ROE), Dividend Payout Ratio (DPR) and Price Earning Ratio (PER) have an effect on stock return. Partially Return On Asset (ROA), Return On Equity (ROE), and Price Earning Ratio (PER) have an effect on stock return. Dividend Payout Ratio (DPR) has no effect on stock return.

Keyword : *Return On Asset* (ROA), *Return On Equity* (ROE), *Dividend Payout Ratio* (DPR), *Price Earning Ratio* (PER), *Stock Return saham*