

ABSTRAK

Suhardiningsih, Ika. 2018. **Pengaruh *Return On Equity* (ROE) Dan *Price Earning Ratio* (PER) Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada Perusahaan Dalam Kelompok *Jakarta Islamic Index* (JII) Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2013 – 2017)**. Program Studi Manajemen, Fakultas Ekonomi, Universitas Panca Marga Probolinggo.

Penelitian ini dilakukan pada perusahaan dalam kelompok *Jakarta Islamic Index* (JII) yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia sebanyak 29 perusahaan yang mempunyai laporan keuangan dapat diakses dari tahun 2013 – 2017 dengan tujuan untuk mengetahui pengaruh *Return On Equity* (ROE) dan *Price Earning Ratio* (PER) secara simultan dan secara parsial terhadap *return* saham pada Perusahaan dalam Kelompok *Jakarta Islamic Index* (JII) yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2013 – 2017 dan untuk mengetahui variabel di antara *Return On Equity* (ROE) dan *Price Earning Ratio* (PER) yang berpengaruh dominan terhadap *return* saham pada Perusahaan dalam Kelompok *Jakarta Islamic Index* (JII) yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2013 – 2017.

Jenis penelitian yang digunakan adalah penelitian kausal. Metode pengumpulan data dengan dokumentasi, sampel sebanyak 29 perusahaan dalam kelompok *Jakarta Islamic Index* (JII) yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia yang mempublikasikan laporan keuangan tahunan (*annual report*) secara lengkap periode 2013 – 2017. Metode analisis data berupa analisis regresi linear berganda.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa ada pengaruh *Return On Equity* (ROE) dan *Price Earning Ratio* (PER) secara simultan terhadap *return* saham pada Perusahaan dalam Kelompok *Jakarta Islamic Index* (JII) yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2013 – 2017 yang ditunjukkan dengan nilai F_{hitung} (268,141) dan $p-value = 0,000 < 0,05$, ada pengaruh *Return On Equity* (ROE) dan *Price Earning Ratio* (PER) secara parsial terhadap *return* saham pada Perusahaan dalam Kelompok *Jakarta Islamic Index* (JII) yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2013 – 2017. Variabel *Price Earning Ratio* (PER) yang berpengaruh dominan terhadap *return* saham pada Perusahaan dalam Kelompok *Jakarta Islamic Index* (JII) yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2013 – 2017.

Kata Kunci : *Jakarta Islamic Index* (JII), *Return On Equity* (ROE) dan *Price Earning Ratio* (PER)