



Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah.
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar UIN Suska Riau.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin UIN Suska Riau.

ABSTRAK

**PENGARUH *PRICE EARNING RATIO*, *DEBT TO EQUITY RATIO*,
RETURN ON EQUITY DAN *FIRM SIZE* TERHADAP *SHARIA
STOCK RETURN* (STUDI KASUS PADA PERUSAHAAN
YANG TERDAFTAR DALAM *JAKARTA ISLAMIC
INDEX* PERIODE 2013-2017)**

Oleh :

NOVRI AYUNING UTAMI
NIM.11471202460

Penelitian ini bertujuan untuk mendapatkan bukti empiris mengenai pengaruh *Price Earning Ratio*, *Return on Equity*, *Debt to Equity Ratio*, dan *Firm Size* terhadap *Sharia Stock Return* pada perusahaan yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index*. Data penelitian merupakan data sekunder diperoleh dari *Indonesian Capital Market Directory* (ICMD) dan Laporan Keuangan Tahunan Perusahaan tahun 2013-2017. Teknik pengambilan sampel menggunakan metode *purposive sampling* sehingga diperoleh 16 perusahaan dan analisis yang digunakan adalah analisis regresi data panel dengan alat bantu aplikasi Eviews versi 10.0. Hasil penelitian menunjukkan bahwa variabel *Price Earning Ratio* berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Sharia Stock return* dengan tingkat signifikansi sebesar $0.0148 < 0.05$, *Debt to Equity Ratio* berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Sharia Stock Return* dengan tingkat signifikansi sebesar $0.0317 < 0.05$. *Return On Equity* berpengaruh positif dan signifikan terhadap *Sharia Stock Return* dengan tingkat signifikansi sebesar $0.0061 < 0.05$, sedangkan *Firm Size* tidak berpengaruh signifikan terhadap *Sharia Stock Return* dengan tingkat signifikansi sebesar $0.0717 > 0.05$. Hasil pengujian secara simultan diperoleh $F_{hitung} > F_{tabel} = 22.17180 > 2.525$ berarti hipotesis secara simultan antara *Price Earning Ratio*, *Return on Equity*, *Debt to Equity Ratio*, dan *Firm Size* secara bersama-sama berpengaruh terhadap *Sharia Stock Return*. Dari hasil penelitian ini juga diperoleh koefisien determinasi (R^2) dengan nilai 0.626908 atau 62.69 % yang berarti bahwa *Sharia Stock Return* dapat dipengaruhi oleh *Price Earning Ratio*, *Return on Equity*, *Debt to Equity Ratio*, dan *Firm Size*. Sedangkan 37.31 % sisanya merupakan varian yang tidak dijelaskan dalam penelitian ini.

Kata Kunci: Sharia Stock Return, Price Earning Ratio, Debt to Equity Ratio, Return on Equity, Firm Size