

ABSTRAK

Tujuan penelitian ini adalah untuk melakukan analisis terhadap pengaruh pengukuran kinerja keuangan dengan menggunakan rasio keuangan yaitu rasio profitabilitas, rasio solvabilitas, dan rasio pasar, yang digunakan untuk memprediksi *return* saham pada perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII)

Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah perusahaan-perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index selama tahun 2010 sampai dengan tahun 2013. Pengambilan sampel perusahaan dalam penelitian ini dilakukan dengan *purposive sampling* yaitu dengan didasarkan pada perusahaan-perusahaan yang menerbitkan laporan keuangan resmi dan informasi harga saham selama periode pengamatan. Data tersebut diperoleh dari *Indonesian Stock Exchange (IDX)*, *Yahoo Finance*, dan situs resmi perusahaan. Alat analisa data dalam penelitian ini menggunakan program spss 16.0. Selanjutnya untuk menguji pengaruh variabel independen terhadap variabel dependen menggunakan analisis regresi linier berganda. Jumlah sampel yang digunakan dalam penelitian ini sebanyak 16 perusahaan dalam jangka waktu 4 tahun.

Dari hasil penelitian dapat ditarik kesimpulan bahwa variabel rasio keuangan yang menggunakan ROE, DER, PER, PBV, dan EPS secara bersama-sama memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham syariah. Hasil pengujian secara parsial pada variabel rasio ROE, DER, dan PER yang memiliki pengaruh positif terhadap *return* saham syariah. Sedangkan pada variabel rasio PBV dan EPS tidak memiliki pengaruh terhadap *return* saham syariah.

Kata Kunci: Rasio Profitabilitas (ROE), Rasio Solvabilitas (DER), Rasio Pasar (PER, PBV, dan EPS), dan *Return* Saham