

## ABSTACT

The development of Islamic capital market very rapidly in Indonesia, can be seen on 2014, capitalization of stock market is dominated by sharia companies. Therefore, researchers wanted to know what are the fundamental factors that can affect stock return of sharia, because stock returns in great demand and the main destination for investors. This study examined the companies listed in Jakrata Islamic Index from the period 2009-2014.

Variables used in this study is the Current Ratio (CR), Return on Assets (ROA), Debt To Equity Ratio (DER), and Earning Per Share (EPS). The results showed that partially CR has a negative and significant impact, ROA has a positive and significant impact, DER has a negative and significant impact, and EPS has no effect on stock returns. While simultaneously all variables significant influence.

**Keywords :** *Stock return, Current Ratio, Return On Asst, Debt To Quity Ratio, dan Earning Per Share.*

## INTISARI

Perkembangan pasar modal syariah sangat pesat di Indonesia, dapat dilihat pada 2014, kapitalisasi pasar modal didominasi dengan emiten syariah. Maka dari itu, peneliti ingin mengetahui apa saja faktor fundamental yang dapat mempengaruhi return saham syariah, karena return saham banyak diminati dan tujuan utama para investor. Penelitian ini meneliti perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index dari periode 2009-2014

Variabel yang digunakan dalam penelitian ini adalah *Current Ratio (CR)*, *Return On Asset (ROA)*, *Debt To Equity Ratio (DER)*, dan *Earning Per Share (EPS)*. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa secara parsial CR memiliki pengaruh negatif dan signifikan, ROA memiliki pengaruh positif dan signifikan, DER memiliki pengaruh negatif dan signifikan, dan EPS tidak berpengaruh terhadap return saham. Sedangkan secara simultan semua variabel berpengaruh secara signifikan.

**Kata Kunci :** Return saham, *Current Ratio*, *Return On Asst*, *Debt To Quity Ratio*, dan *Earning Per Share*.