

INTISARI

Penelitian ini dilakukan untuk menganalisis faktor-faktor fundamental yang mempengaruhi *return* saham syariah pada perusahaan yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* selama periode 2005-2009. Faktor fundamental yang diteliti adalah *Debt to Equity Ratio* (DER), *Earning Per Share* (EPS), *Net Profit Margin* (NPM), *Price Book Value* (PBV), *Price Earning Ratio* (PER), dan *Return On Equity* (ROE). Pengambilan sampel menggunakan metode *purposive sampling* dan diperoleh 43 perusahaan sebagai sampel penelitian. Alat analisis dalam penelitian ini menggunakan regresi linier berganda (*Multiple Regression*).

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa faktor fundamental DER, EPS, NPM, PBV, PER, dan ROE secara simultan berpengaruh signifikan terhadap *return* saham syariah. Secara parsial, variabel EPS dan PBV berpengaruh signifikan terhadap *return* saham syariah. Variabel DER, NPM, PER, dan ROE tidak berpengaruh terhadap *return* saham syariah. Sedangkan variabel PBV yang mempunyai pengaruh dominan untuk mempengaruhi *return* saham syariah.

Kata kunci : *Debt to Equity Ratio* (DER), *Earning Per Share* (EPS), *Net Profit Margin* (NPM), *Price Book Value* (PBV), *Price Earning Ratio* (PER), *Return On Equity* (ROE) dan *Return Saham Syariah*.