

ABSTRAK

Mohammad Mabror, 2022, Analisis Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Return Saham Yang Terdaftar Di Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI), Skripsi, Program Studi Akuntansi Syariah, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam, Institut Agama Islam Negeri Madura, Pembimbing: Uly Mabruroh Halida, M.E.

Kata Kunci: *Debt to Equity Ratio, Erning Per Share, Return On Equity, Total Assets Turnover, Current Ratio.*

Fenomena yang diangkat dalam penelitian ini yaitu bahwa adanya angka pada saat pembukaan dengan penutupan harga saham di ISSI (Indeks Saham Syariah Indonesia) periode 2019-2021 mengalami suatu kenaikan yang cukup tinggi setelah harga pembukaan dilakukan.

Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif dengan jenis penelitian kausal dan menggunakan metode analisis regresi linier berganda. Sumber data pada penelitian ini diperoleh dari data sekunder berupa laporan keuangan tahunan yang didapat melalui *website* resmi Bursa Efek Indonesia dan beberapa sumber lainnya dengan jumlah sampel sebanyak 14 perusahaan menggunakan tiga (3) periode (2019-2021) yang berarti data sampel pada penelitian ini berjumlah sebanyak empat puluh dua (42) data. Teknik pengambilan sampel menggunakan teknik *purposive sampling*.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa *Debt to Equity Ratio* (DER) tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham yang terdaftar di Indeks Saham Syariah Indonesia. Hal ini ditunjukkan dengan hasil yang diperoleh sebesar 0,724 dan dengan tingkat sig. 0,05 yang berarti bahwa $0,724 > 0,05$. *Earning Per Share* (EPS) tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham yang terdaftar di Indeks Saham Syariah Indonesia. Hal ini ditunjukkan dengan hasil yang diperoleh sebesar 0,246 dan dengan tingkat sig. 0,05 yang berarti bahwa $0,246 > 0,05$. *Return On Equity* (ROE) tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham yang terdaftar di Indeks Saham Syariah Indonesia. Hal ini ditunjukkan dengan hasil yang diperoleh sebesar 0,960 dan dengan tingkat sig. 0,05 yang berarti bahwa $0,960 > 0,05$. *Total Asset Turnover* (TATO) tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham yang terdaftar di Indeks Saham Syariah Indonesia. Hal ini ditunjukkan dengan hasil yang diperoleh sebesar 0,843 dan dengan tingkat sig. 0,05 yang berarti bahwa $0,843 > 0,05$. *Current Rasio* (CR) tidak berpengaruh signifikan terhadap return saham yang terdaftar di Indeks Saham Syariah Indonesia. Hal ini ditunjukkan dengan hasil yang diperoleh sebesar 0,448 dan dengan tingkat sig. 0,05 yang berarti bahwa $0,448 > 0,05$.