

ABSTRAK

Hendi Valerian (1178020091): “Pengaruh Rasio Profitabilitas Terhadap Return Saham Perusahaan Yang Terdaftar Di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2015-2019”

Investasi merupakan sebuah kegiatan yang saat ini banyak dilakukan karena dapat menambah pundi-pundi penghasilan secara pasif. Tujuan dari orang menjadi sebuah investor adalah untuk mendapatkan *Return* saham. Return saham adalah keuntungan yang diperoleh oleh investor dari apa yang dikeluarkannya (modal). Hal-hal yang dapat mempengaruhi return saham dapat berasal dari luar dan dalam perusahaan, salah satunya yaitu rasio profitabilitas. Rasio profitabilitas adalah rasio yang memberikan informasi mengenai keuntungan sebuah perusahaan. Dengan mempelajari rasio ini investor dapat mengetahui bagaimana perkembangan profit dari perusahaan agar dapat memprediksi *Return* yang akan didapatkannya. Variabel rasio profitabilitas yang digunakan adalah *Return on Assets*, *Return on Equity*, *Earning Per Share*, dan *Net Profit Margin*. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui apakah Rasio profitabilitas berpengaruh terhadap *Return* saham pada objek perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index periode 2015-2019.

Penelitian ini dilakukan dengan penggunaan data sekunder yang berasal dari *website* resmi dan *website* perusahaan terkait, penelitian ini dilakukan dengan teknik penelitian kuantitatif dengan metode deskriptif dan verifikatif. Sampel penelitian didapatkan melalui metode sampel purposif. Teknik analisis data menggunakan regresi data panel untuk melakukan uji t (parsial), uji f (simultan), dan uji koefisien determinasi. Model penelitian menggunakan *Fixed Effect Model*. Hasil penelitian ini menunjukkan (1) ROA secara parsial berpengaruh secara positif dan signifikan terhadap *Return* saham, karena hasil uji t-hitung 2.118750 lebih besar dari t-tabelnya yaitu 1.66864, dan signifikansinya 0.0389 memiliki nilai yang lebih kecil dari alfa yaitu 0.05. (2) ROE secara parsial tidak berpengaruh dan tidak signifikan terhadap *Return* Saham karena hasil uji t-hitung 0.292982 lebih kecil dari t-tabelnya yaitu 1.66864, dan signifikansinya 0.7707 lebih besar dari alfa 0.05. (3) EPS secara parsial tidak berpengaruh dan tidak signifikan terhadap *Return* saham, karena hasil uji t-hitung 0.991871 lebih kecil dari nilai t-tabelnya 1.66864, dan signifikansinya 0.3259 memiliki nilai yang lebih besar dari alfa 0.05. (4) NPM secara parsial tidak berpengaruh dan tidak signifikan terhadap *Return* saham, karena hasil uji t-hitung -0.685058 lebih kecil dari nilai t-tabelnya yaitu 1.66864, dan signifikansinya 0.4963 lebih besar dari alfa yaitu 0.05. (5) ROA, ROE, EPS, NPM secara simultan tidak berpengaruh dan tidak signifikan karena hasil uji f-hitung 1.220896 lebih kecil dari nilai f-tabelnya yaitu 2.52, dan nilai signifikansinya 0.282194 lebih besar dari 0.05. Untuk nilai R^2 nya adalah 28.52%

Kata Kunci: Rasio Profitabilitas, Return on Assets, Return on Equity, Earning per Share, Net Profit Margin, Return saham.