

ABSTRAK

Nur Jamilatul Wahidah (1720210214). Pengaruh *Earning Per Share* (EPS), *Net Profit Margin* (NPM) dan *Price Earning Ratio* (PER) Terhadap *Return Saham* Pada Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta *Islamic Index* (JII) Tahun 2015-2019.

Skripsi ini bertujuan untuk menguji secara empiris mengenai pengaruh *Earning Per Share* (EPS) terhadap *return* saham pada perusahaan yang terdaftar di Jakarta *Islamic Index* (JII) tahun 2015-2019, pengaruh *Net Profit Margin* (NPM) terhadap *return* saham pada perusahaan yang terdaftar di Jakarta *Islamic Index* (JII) tahun 2015-2019, dan pengaruh *Price Earning Ratio* terhadap *return* saham pada perusahaan yang terdaftar di Jakarta *Islamic Index* (JII) tahun 2015-2019.

Penelitian ini menggunakan jenis penelitian korelasional dengan pendekatan kuantitatif. Objek penelitian ini adalah perusahaan yang terdaftar di Jakarta *Islamic Index* (JII) selama periode 2015-2019. Teknik pengumpulan sampel menggunakan *purposive sampling*, dengan sampel 15 perusahaan. Metode analisis data yang digunakan adalah analisis regresi data panel menggunakan *software Eviews 9*.

Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa variabel *Earning Per Share* (EPS) berpengaruh positif signifikan terhadap *return* saham. Hal ini dapat dibuktikan dengan hasil uji parsial (t) dengan nilai probabilitas yang lebih kecil dari tingkat signifikansi, serta nilai t_{hitung} yang lebih besar dari t_{tabel} . Untuk variabel *Net Profit Margin* (NPM) menunjukkan hasil bahwa NPM berpengaruh positif signifikan terhadap *return* saham. Hal ini dapat dibuktikan dengan hasil uji parsial (t) dengan nilai probabilitas yang lebih kecil dari tingkat signifikansi, serta nilai t_{hitung} yang lebih besar dari t_{tabel} . Sedangkan variabel *Price Earning Ratio* (PER) menunjukkan hasil bahwa PER tidak berpengaruh terhadap *return* saham. Hal ini dapat dibuktikan dengan hasil uji parsial (t) dengan nilai probabilitas yang lebih besar dari tingkat signifikansi, serta nilai t_{hitung} yang lebih kecil dari t_{tabel} .

Kunci : *Return Saham, Earning per Share, Net Profit Margin, Price Earning Ratio*