

ABSTRAK

Rempan Mahal Prahara (1138020197): Pengaruh Rasio Aktivitas (TATO, TOR), Rasio Profitabilitas (ROA, ROE) dan Rasio Pasar (PER, PBV) terhadap *Return Saham* pada perusahaan yang *listing* di *Jakarta Islamic Index* (JII) periode 2010-2016.

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui seberapa besar pengaruh *Total Asset Turnover*, *Turnover Receivable*, *Return On Asset*, *Return On Equity*, *Price Earning Ratio* dan *Price Book Value* terhadap *Return* saham yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* (JII). Juga untuk menyediakan informasi yang aktual mengenai *Jakarta Islamic Index* (JII).

Data yang digunakan adalah data panel dari 7 perusahaan tahun 2010-2016. Adapun pengujianya dengan menggunakan metode analisis regresi data panel dengan menggunakan metode *Fixed Effects*.

Berdasarkan uji regresi data panel melalui metode *Fixed Effect* didapatkan hasil yaitu: (1) Terdapat pengaruh positif dan signifikan secara parsial *Total Asset Turnover* (TATO) terhadap *Return* saham. (2) Tidak terdapat pengaruh secara parsial *Turnover Receivable* (TOR) terhadap *Return* saham. (3) Terdapat pengaruh negatif dan signifikan secara parsial *Return On Asset* (ROA) terhadap *Return* saham. (4) Terdapat pengaruh positif dan signifikan secara parsial *Return On Equity* (ROE) terhadap *Return* saham. (5) Tidak terdapat pengaruh secara parsial *Price Earning Ratio* (PER) terhadap *Return* saham. (6) Terdapat pengaruh positif dan signifikan secara parsial *Price Book Value* (PBV) terhadap *Return* saham. (7) Terdapat pengaruh secara Simultan antara *Total Asset Turnover* (X_1), *Turnover Receivable* (X_2), *Return On Asset* (X_3), *Return On Equity* (X_4), *Price Earning Ratio* (X_5) dan *Price Book Value* (X_5) Terhadap *Return* saham (Y).

Besarnya koefisien determinasi yang didapat nilai R Square adalah 0.852620 artinya bahwa sebesar 85,26% perubahan variabel dependen *return* saham dipengaruhi oleh *Total Asset Turnover*, *Turnover Receivable*, *Return On Asset*, *Return On Equity*, *Price Earning Ratio* dan *Price Book Value* sedangkan sisanya 14,74% dipengaruhi oleh faktor lain diluar variabel yang diteliti dalam penelitian ini, dapat disimpulkan bahwa tingkat hubungan antar variabel kuat.

Kata Kunci: *Total Asset Turnover* (TATO), *Turnover Receivable* (TOR), *Return On Asset* (ROA), *Return On Equity* (ROE), *Price Earning Ratio* (PER), *Price Book Value* (PBV), *Return*.