

ABSTRAK

Saham *syariah* merupakan saham dari perusahaan-perusahaan yang dalam operasionalnya tidak bertentangan dengan *syariat* Islam, baik mengenai produk maupun manajemennya. Kelompok saham *syariah* ini dimasukkan dalam *Jakarta Islamic Index* (JII). Investor dalam melakukan investasi pada saham harapan yang diinginkan adalah memperoleh *return*. Pilihan investor terhadap saham perusahaan yang tergabung dalam kelompok saham *syariah* juga tidak lepas dari adanya *return* yang diharapkan. Salah satu alat untuk menganalisis *return* saham adalah analisis rasio keuangan diantaranya *Total Asset Turn Over* (TATO), *Return On Asset* (ROA), dan *Earning Per Share* (EPS).

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh *Total Asset Turn Over* (TATO), *Return On Asset* (ROA), dan *Earning Per Share* (EPS) terhadap *return* saham pada perusahaan-perusahaan dalam *Jakarta Islamic Index* (JII) periode 2010-2012.

Jumlah anggota populasi saham *syariah* adalah 51 perusahaan yang diambil selama periode tiga tahun (2010-2012). Dan jumlah sampel yang memenuhi kriteria sebanyak 22 perusahaan, dengan pengamatan kinerjanya selama tiga tahun (2010-2012), sehingga jumlah keseluruhan sebanyak 66 pengamatan. Metode pengambilan sampel dilakukan dengan menggunakan *purposive sampling*. Metode pengujian hipotesis yang digunakan adalah analisis regresi linier sederhana dan berganda.

Hasil penelitian ini secara regresi linier sederhana menunjukkan *Total Asset Turn Over* (TATO) memiliki pengaruh negatif yang tidak signifikan terhadap *return* saham. Sedangkan *Return On Asset* (ROA) dan *Earning Per Share* (EPS) memiliki pengaruh negatif yang signifikan terhadap *return* saham. Dan hasil penelitian secara simultan menunjukkan bahwa *Total Asset Turn Over* (TATO), *Return On Asset* (ROA), dan *Earning Per Share* (EPS) secara bersama-sama memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham dengan tingkat signifikan sebesar 0,007.

Kata kunci : *Return Saham*, *Total Asset Turn Over* (TATO), *Return On Asset* (ROA), dan *Earning Per Share* (EPS).