

ABSTRACT

ADE ZIQRI N ARIEF, 082277210002 Characteristics Analysis Companies And Industri Stock Return Against Sharia in Indonesia Stock Exchange. Accounting Programs Accounting Program. Faculty of Economics, University of Medan.

The problems discussed in this study is an analysis of firm and industry characteristics to retrun Islamic stocks on the Indonesia Stock Exchange. The purpose of this study was to examine whether factors Earning Per Share, Dividend Per Share, Current Ratio, Return on Equity, and Return Company Size effect on the company's shares are listed as Jakarta Islamic Index.

The study population was all companies and industries in Indonesia Stock Exchange. Determination sempel study was conducted with a purposive sampling method. This study used multiple linear regression model testing. Before testing the hypothesis, it must first be tested and test data normality classical assumptions. Testing is to be able to say whether the model has been formed to meet the assumptions of regression models were good.

The results of this study indicate that the probability value of the test data under the desired significance level of 5%. These results are reflected in pegujian partially or t test and the simultaneous testing or test F. Before testing the hypothesis, testing has also been performed classical assumptions and normality of data. The results showed that no data has been normal and have met a good regression model assumptions.

The conclusion of this study indicate that the Earning Per Share, Dividend Per Share, Current Ratio, Return on Equity, and size does not affect the Company's Stock Return index of companies that are members of the JII either partially or simultaneously.

Keywords: Return, index, stocks.



ABSTRAK

ADE ZIQRI N ARIEF, 082277210002 Analisa Karakteristik Perusahaan Dan Industri Terhadap *Return Saham Syariah* Di Bursa Efek Indonesia. Jurusan Akuntansi Program Studi Akuntansi. Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Medan.

Permasalahan yang di bahas dalam penelitian ini adalah analisa karakteristk perusahaan dan industri terhadap *retrun* saham syariah di Bursa Efek Indonesia. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk menguji apakah faktor *Earning Per Share*, *Dividend Per Share*, *Current Ratio*, *Return on Equity*, dan Ukuran Perusahaan berpengaruh terhadap *Return Saham* pada perusahaan yang terdaftar sebagai *Jakarta Islamic Index*.

Populasi penelitian ini adalah seluruh perusahaan dan industri di Bursa Efek Indonesia. Penentuan sempel penelitian ini dilakukan dengan metode *purposive sampling*. Penelitian ini menggunakan model pengujian regresi linear berganda. Sebelum dilakukan pengujian hipotesis, terlebih dahulu harus dilakukan pengujian normalitas data dan pengujian asumsi klasik. Pengujian tersebut untuk dapat menyatakan apakah model yang dibentuk telah memenuhi asumsi model regresi yang baik.

Hasil dari penelitian ini menunjukkan bahwasanya nilai probabilitas dari pengujian data, berada dibawah tingkat signifikansi yang diinginkan sebesar 5%. Hasil ini tercermin pada pegujian secara parsial atau uji t dan pada pengujian secara simultan atau uji F. Sebelum pengujian hipotesis tersebut, juga telah dilakukan pengujian asumsi klasik dan normalitas data. Hasil yang ada menunjukkan bahwa data telah normal dan telah memenuhi asumsi model regresi yang baik.

Kesimpulan dari penelitian ini menunjukkan bahwa *Earning Per Share*, *Dividend Per Share*, *Current Ratio*, *Return on Equity*, dan Ukuran Perusahaan tidak berpengaruh terhadap *Return Saham* perusahaan yang tergabung pada indeks JII baik secara parsial maupun simultan.

Kata kunci: *Return, index, Saham.*