

**PENGARUH *GOOD CORPORATE GOVERNANCE*,
PROFITABILITAS, *LEVERAGE* TERHADAP *RETURN*
SAHAM PADA PERUSAHAAN JAKARTA ISLAMIC INDEX
DI BURSA EFEK INDONESIA**

Oleh :

Nurul Fadhillah

43210010188

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan mengetahui pengaruh Ukuran Dewan Komisaris (UDK), Komite Audit (KA), *Return On Asset* (ROA) dan *Debt to Equity Ratio* (DER) terhadap *Return* Saham.

Penelitian ini menggunakan metode *purposive sampling* dan menggunakan sampel penelitian dari perusahaan yang tergabung dalam Jakarta Islamic Index yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode tahun 2010 – 2012 dan diperoleh 14 perusahaan sebagai sampel, sehingga selama 3 tahun pengamatan terdapat 42 laporan keuangan yang dianalisis. Variabel yang diuji dalam penelitian ini terdiri dari ukuran dewan komisaris, komite audit, ROA dan DER. Teknik analisis yang digunakan adalah analisis regresi linear berganda dan uji hipotesis menggunakan uji t secara parsial, uji F secara simultan.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa data ROA dan KA secara parsial tidak memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham, sedangkan data UDK dan KA memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham. Secara simultan UDK, KA, ROA dan DER terbukti signifikan berpengaruh terhadap *return* saham pada perusahaan yang tergabung dalam *Jakarta Islamic Index* di Bursa Efek Indonesia.

Kata Kunci : Ukuran Dewan Komisaris (UDK), Komite Audit (KA), *Return On Asset* dan *Debt to Equity Ratio* (DER) terhadap *Return* Saham.

***EFFECT OF GOOD CORPORATE GOVERNANCE,
PROFITABILITY, LEVERAGE TO STOCK RETURN AT
JAKARTA ISLAMIC INDEX LISTED IN INDONESIA
STOCK EXCHANGE***

by :

Nurul Fadhillah

43210010188

ABSTRACT

This study aims to determine the effect size of the Board of Commissioners (UDK), the Audit Committee (KA), Return on Assets (ROA) and Debt to Equity Ratio (DER) to the Stock Return.

This research is using purposive sampling method and use of company research of company research sample is Jakarta Islamic Index, which listed in Indonesia Stock Exchange period 2010-2012 and acquired 14 companies in the sample, so as long as 3 years observation there were 42 annual report were analyzed. The variable examined in this research is Board of Commissioners, the Audit Committee, ROA and DER. The analysis technique used is multiple linear regression analysis and hypothesis testing using the t test partially, simultaneous F test.

The result showed that the ROA and KA data is partially not have a significant effect on stock returns, while the partial UDK and DER data has a significant impact on stock returns. Simultaneously UDK, KA, ROA and DER significant effect on stock returns at Jakarta Islamic Index, which listed in Indonesia Stock Exchange.

Keywords : board of commissioners, audit committee, return on assets, debt to equity ratio and stock return