

## ABSTRAK

Skripsi ini membahas bagaimana pengaruh dari *Return On Assets* dan *Price Earning Ratio* terhadap *return* saham. Data yang diambil merupakan data laporan keuangan dan harga tahunan Perusahaan yang tergabung dalam Jakarta Islamic Index sejak tahun 2007 hingga tahun 2010 dengan memperoleh data dari Pojok Bursa Universitas Mercubuana dan website BEI. Teknik pengambilan sampel dalam penelitian ini adalah dengan menggunakan metode *purposive sampling*, sedangkan metode analisis data yang digunakan adalah regresi linier berganda.

Hasil pengujian hipotesis menunjukkan bahwa *Return On Asset* dan *Price Earning Ratio* secara bersama-sama atau simultan mempengaruhi *return* saham perusahaan yang tergabung dalam Jakarta Islamic Index. Namun, secara parsial *Return On Asset* memiliki pengaruh yang tidak signifikan terhadap *return* saham perusahaan yang tergabung dalam Jakarta Islamic Index, sedangkan *Price Earning Ratio* secara parsial berpengaruh dan signifikan terhadap *return* saham perusahaan yang tergabung dalam Jakarta Islamic Index. Bagi peneliti selanjutnya disarankan untuk memperhatikan faktor lain yang dapat mempengaruhi pergerakan *return* saham perusahaan yang tergabung dalam Jakarta Islamic Index.

Kata kunci: *Return On Asset*, *Price Earning Ratio*, dan *return* saham.