

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji “Pengaruh Faktor Fundamental dan Corporate Governance Terhadap Return Saham Syariah Perusahaan *Go Public* pada *Jakarta Islamic Index* (JII). Dengan mengambil data sekunder yang telah dipublikasikan pada periode 2013 - 2017. Analisis data dalam penelitian ini menggunakan uji asumsi klasik (uji normalitas, uji multikolonieritas, uji autokorelasi, Uji heteroskedastisitas) analisis uji koefisien regresi, koefisien regresi secara parsial (uji t), koefisien regresi secara bersama-sama (uji F) Adapun keseluruhan analisis data menggunakan komputer dengan software *SPSS 21*.

Hasil penelitian ini menyimpulkan bahwa : (1) DER berpengaruh secara signifikan terhadap *return* saham syariah pada perusahaan *go public* yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* (JII) pada tahun 2013-2017. (2) EPS tidak berpengaruh secara signifikan terhadap *return* saham syariah pada perusahaan *go public* yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* (JII) 2013-2017. (3) ROE tidak berpengaruh secara signifikan terhadap *return* saham syariah pada perusahaan *go public* yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* (JII) pada tahun 2013-2017. (4) Dewan Komisaris Independen berpengaruh negatif terhadap *return* saham syariah pada perusahaan *go public* yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* (JII) pada tahun 2013-2017. (5) Komite Audit berpengaruh negatif terhadap *return* saham syariah pada perusahaan *go public* yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* (JII) pada tahun 2013-2017. Berdasarkan hasil penelitian diatas maka penulis menyarankan bagi peneliti yang ingin meneliti dibidang yang sama dapat menambah periode penelitian serta menambah variabel-variabel *return* saham lainnya yang ada didalam prospektus yang memiliki kemungkinan berpengaruh terhadap *return* saham.

Kata Kunci : DER, EPS, ROE, Dewan Komisaris Independen, Komite Audit