

ABSTRAK

Skripsi ini adalah hasil dari penelitian yang berjudul “Pengaruh *Economic Value Added* dan *Return on Asset* Terhadap *Return* Saham Pada Perusahaan Yang Tercatat di *Jakarta Islamic Index* Periode 2013”. Penelitian ini bertujuan untuk menjawab tiga rumusan masalah yaitu, Berapa besar pengaruh EVA dan ROA secara parsial terhadap *Return* Saham pada perusahaan yang tercatat di JII, Berapa besar pengaruh EVA dan ROA secara simultan terhadap *return* saham pada perusahaan yang tercatat di JII dan Variabel mana yang paling berpengaruh terhadap *return* saham pada perusahaan yang tercatat di JII periode 2013.

Pendekatan yang digunakan adalah pendekatan kuantitatif dengan menggunakan teknik analisis regresi linear berganda dengan dua variabel yaitu *Economic Value Added* dan *Return on Asset* sebagai variabel Independen dan *Return Saham* sebagai variabel Dependen. Data yang digunakan adalah data sekunder, pengumpulan data yang diperoleh dari IDX Surabaya.

Hasil penelitian menyimpulkan bahwa *Economic Value Added* dan *Return on Asset* berpengaruh tidak signifikan secara parsial terhadap *return* saham dengan nilai signifikan sebesar 0,333 lebih besar dari 0,05, demikian dengan *Economic Value Added* dan *Return on Asset* berpengaruh tidak signifikan secara simultan dengan nilai signifikan sebesar 0,609 lebih besar dari 0,05. Diantar kedua variabel tidak ada yang berpengaruh terhadap *return* saham. Kemampuan variabel independen menjelaskan variabel dependen sebesar 3,6% sangat rendah sekali, sedangkan sisanya 96,4 % dipengaruhi oleh variabel lain dan tidak termasuk dalam analisis regresi ini.

Bagi penelitian selanjutnya di harapkan menambah rasio keuangan lainnya sebagai variabel independen, karena sangat di mungkin rasio keuangan lain yang tidak di masukkan dalam penelitian ini berpengaruh terhadap perubahan *return* saham.

Kata kunci : *Economic Value Added*, *Return on Asset* dan *Return Saham*