

# **PENGARUH PROFITABILITAS, UKURAN PERUSAHAAN, RISIKO SISTEMATIS DAN GOOD CORPORATE GOVERNANCE TERHADAP RETURN SAHAM SYARIAH**

(Studi Empiris pada perusahaan JII yang terdaftar di BEI periode 2015-2019)

**Oleh :**

**MEILA ANNISA**

**1612120103**

## **ABSTRAK**

Penelitian ini bertujuan untuk membuktikan secara empiris Pengaruh Profitabilitas, Ukuran Perusahaan, Risiko Sistematis dan Good Corporate Governance Terhadap Return Saham Syariah Pada Perusahaan Yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2015-2019. Dalam penelitian ini terdapat 6 variabel Independen yang diuji yaitu Profitabilitas, Ukuran Perusahaan, Risiko Sistematis, Kepemilikan Manajerial, Kepemilikan Institusional dan Komite Audit. Populasi dari penelitian ini adalah Perusahaan Yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2015-2019. Teknik *sampling* yang digunakan adalah *purposive sampling*, sehingga dapat memperoleh sampel sebanyak 30 perusahaan. Penelitian ini dilakukan pada tahun 2015-2019, sehingga jumlah data dalam penelitian ini sebanyak 150 data. Metode analisis yang digunakan adalah regresi linier berganda dengan alat SPSS V.20. Hasil penelitian membuktikan bahwa Profitabilitas, Kepemilikan Manajerial berpengaruh signifikan terhadap Return Saham Syariah. Dan Ukuran Perusahaan, Resiko Sitematis, Kepemilikan Institusional dan Komite Audit tidak berpengaruh secara signifikan terhadap Return Saham Syariah.

**Keywords : Profitabilitas, Ukuran Perusahaan, Risiko Sistematis, Kepemilikan Manajerial, Kepemilikan Institusional dan Komite Audit, Return Saham Syariah.**

**THE EFFECT OF PROFITABILITY, COMPANY SIZE, SYSTEMATIC RISK, AND  
GOOD CORPORATE GOVERNANCE ON SHARIA SHARE RETURNS  
(Empirical Study of Listed JII Companies on the IDX for the period 2015-2019)**

**By:**

**MEILA ANNISA**

**1612120103**

**ABSTRACT**

The purpose of this study was to find empirically the effect of profitability, company size, systematic risk, and good corporate governance on the sharia stocks return in listed companies on the Jakarta Islamic Index (JII) for the 2015-2019 period. In this study, there were 6 independent variables tested, namely Profitability, Company Size, Systematic Risk, Managerial Ownership, Institutional Ownership, and the Audit Committee. The population of this study was the companies registered in the Jakarta Islamic Index (JII) for the 2015-2019 period. The sampling technique in this study used purposive sampling with a sample of 30 companies. This study was conducted in 2015-2019 with 150 data. The analysis method used multiple linear regression with the SPSS V.20 tool. The result of this study found that Profitability and Managerial Ownership had a significant effect on Sharia Stock Returns. Meanwhile, company size, systematic risk, institutional ownership, and the audit committee did not have a significant effect on Sharia Stock Return.

**Keywords: Profitability, Company Size, Systematic Risk, Managerial Ownership, Institutional Ownership, Audit Committee, Sharia Stock Return**