

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh *Earning Per Share*, *Total Asset Turn Over* dan Inflasi terhadap *Return Saham* baik secara parsial maupun secara simultan. Objek penelitian ini adalah perusahaan sub sektor plastik dan kemasan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2010-2016.

Penelitian ini tergolong ke dalam jenis penelitian deskriptif verikatif bersifat kausalitas. Data yang digunakan adalah data sekunder dan pemilihan sampel yang menggunakan *purposive sampling* didapatkan sebanyak 63 sampel perusahaan. Metode analisis data dari penelitian ini adalah analisis regresi data panel dengan menggunakan *software* Eviews versi 9.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa secara simultan *Earning Per Share*, *Total Asset Turn Over* dan Inflasi berpengaruh signifikan terhadap *Return Saham*. Sedangkan secara parsial, *Earning Per Share* dan Inflasi berpengaruh positif signifikan terhadap *Return Saham*. Sedangkan *Total Asset Turn Over* tidak berpengaruh terhadap *Return Saham*.

Berdasarkan penelitian ini, maka perusahaan disarankan untuk mempertimbangkan faktor yang mempengaruhi *return saham* seperti tingkat presentase rasio *earning per share* dan inflasi agar dapat meningkatkan *return saham*. Bagi investor dalam berinvestasi sebaiknya memperhatikan *earning per share*. Hal ini karena dalam melakukan investasi, investor seharusnya lebih cermat dalam meneliti keseluruhan kondisi perusahaan dan memperhatikan semua aspek keuangan perusahaan serta mempertimbangkan bagaimana inflasi dapat mempengaruhi kondisi tersebut.

Kata kunci : *Earning Per Share*, *Total Asset Turn Over* dan Inflasi