

## 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