

## ABSTRAK

Industri sub sektor makanan dan minuman memiliki pengaruh besar terhadap pertumbuhan ekonomi di Indonesia dengan menyumbangkan PDB terbesar untuk negara. Tujuan dari penelitian ini untuk mengetahui pengaruh *Debt to Equity Ratio*, *Return On Asset*, *Earning Per Share*, Inflasi dan Kurs terhadap *return* saham sub sektor makanan dan minuman secara simultan dan juga parsial. Tujuan lain dari penelitian ini juga untuk merekomendasikan strategi perusahaan agar dapat meningkatkan kinerja perusahaan serta *return* saham perusahaan sub sektor makanan dan minuman. Dari 18 populasi digunakan 10 sampel perusahaan sub sektor makanan dan minuman yang terdaftar di BEI periode 2012 hingga 2017. Analisis regresi data panel digunakan untuk mengolah data sekunder, *time series*, dan *cross section*.

Analisis regresi data panel menghasilkan DER, ROA, EPS, Inflasi dan Kurs memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham secara simultan serta kurs memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham secara parsial. Rekomendasi strategi didapatkan dengan menyebarkan kuesioner AHP kepada para ahli dan dilakukan analisis SWOT. PT Indofood Sukses Makmur Tbk merupakan perusahaan terpilih mewakili perusahaan lain sub sektor makanan dan minuman dengan melihat kinerja laporan keuangan perusahaan. Analisis SWOT dilakukan dengan penjualan perusahaan yang meningkat setiap tahunnya serta memiliki *return* saham yang risiko kerugiannya paling rendah di antara perusahaan lain.

Kata Kunci : *Return* Saham, Rasio Keuangan, Makro Ekonomi, Analisis Regresi Data Panel, Analisis SWOT