

ABSTRAK

Saat ini, sektor Infrastruktur, Utilitas, dan Transportasi (IUT) menarik perhatian masyarakat karena pembangunan infrastruktur yang meningkat dengan dibuktikan dari anggaran yang meningkat setiap tahunnya. Sehingga, menarik keinginan masyarakat untuk berinvestasi pada sektor tersebut. Namun, *return* saham pada sektor ini mengalami kenaikan dan penurunan. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh DER, ROE, dan EPS, Kurs, Inflasi, dan Pertumbuhan Ekonomi pada sektor Infrastruktur, Utilitas, dan Transportasi terhadap *return saham* secara parsial dan simultan serta memberikan rekomendasi strategi pada perusahaan terpilih dari sektor tersebut. Pengujian data sekunder untuk mengetahui pengaruh secara parsial dan simultan dilakukan dengan menggunakan model regresi data panel. Sedangkan, pengujian data primer dilakukan dengan menyebarkan kuesioner untuk mengetahui posisi dengan metode AHP dan SWOT dalam membuat rekomendasi strategi. Hasil analisis regresi data panel menunjukkan 1 poin DER dan EPS dapat menurunkan *return* saham, lalu 1 poin ROE dapat meningkatkan *return* saham secara parsial. Namun, semua variabel secara simultan memiliki pengaruh yang signifikan terhadap *return* saham karena nilai *prob* (*F-statistic*) < 0,05. Hasil matriks SWOT menunjukkan PT Telkom memiliki posisi pada Kuadran-1 yaitu S-O. Kesimpulannya yaitu enam variabel berpengaruh secara signifikan secara simultan, namun hanya DER, ROE, dan EPS yang memiliki pengaruh yang signifikan secara parsial. Selanjutnya, PT Telkom yang menjadi perwakilan dari sektor Infrastruktur harus mengoptimalkan kekuatan perusahaan dengan memanfaatkan peluang yang ada untuk meningkatkan kinerja perusahaan.

Kata Kunci: *Return Saham, Rekomendasi Strategi, Sektor Infrastruktur, Panel Data Regression, SWOT.*