

ABSTRAK

Perusahaan BUMN atau Badan Usaha Milik Negara merupakan badan usaha dari seluruh atau sebagian modalnya bersumber dari negara melalui penyertaan langsung yang berasal dari kekayaan negara yang dipisahkan. Pada penelitian ini mengambil subsektor Konstruksi (sektor Infrastruktur) pada perusahaan BUMN. Subsektor Konstruksi adalah bagian penting yang berperan dalam pertumbuhan perekonomian suatu negara.

Penelitian ini akan meneliti tentang pengaruh Inflasi, BI Rate, Nilai Tukar, *Earning per Share* (EPS), *Return on Asset* (ROA), *Debt to Equity Ratio*(DER) terhadap *return* saham pada perusahaan BUMN Subsektor Konstruksi pada periode 2015-2018. Metode pada penelitian ini menggunakan metode kuantitatif dengan sumber data yang digunakan bersifat sekunder. Teknik pengambilan data sampel menggunakan teknik purposive sampling.

Hasil dari penelitian ini diperoleh secara simultan dari semua variabel dependen terhadap variabel independen. dan secara parsial penelitian ini pada variabel Inflasi, *BI Rate*, Nilai Tukar dan DER berpengaruh terhadap *return saham*, namun tidak dengan variabel EPS dan ROA yang tidak berpengaruh terhadap *return saham*.

Kata kunci : Inflasi, BI Rate, Nilai Tukar, *Earning per Share*, *Return on Asset*, *Debt to Equity Ratio*.