

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh inflasi, *earnings per share*, dan *price to book value* terhadap *return* saham. Populasi dalam penelitian ini adalah 51 perusahaan *food and beverage* yang Tercatat di Bursa Efek Indonesia Periode 2018-2020. Sampel yang dipergunakan adalah sebanyak 13, dilihat berdasarkan kriteria yang sudah ditentukan. Metode penarikan sampel menggunakan *purposive sampling*. Metode pengumpulan data menggunakan dokumentasi, dengan menggunakan Data Laporan Keuangan Tahunan Perusahaan yang diperoleh dari situs Bursa Efek Indonesia (BEI). Metode analisis data menggunakan teknik analisis regresi data panel. Penelitian ini membuktikan bahwa inflasi tidak berpengaruh terhadap *return* saham. *Earnings per share* (EPS) berpengaruh positif signifikan terhadap *return* saham. *Price to book value* (PBV) berpengaruh positif signifikan terhadap *return* saham.

Kata Kunci : *Inflasi, Earnings Per Share, Price to Book Value, Return Saham*



ABSTRACT

This study aims to analyze the effect of inflation, earnings per share, and price to book value on stock returns. The population in this study were 51 food and beverage companies listed on the Indonesia Stock Exchange for the 2018-2020 period. The sample used is as many as 13, seen based on predetermined criteria. The sampling method used purposive sampling. The data collection method uses documentation, using the Company's Annual Financial Report Data obtained from the Indonesia Stock Exchange (IDX) website. The data analysis method used panel data regression analysis techniques. This study proves that inflation has no effect on stock returns. Earnings per share (EPS) has a significant positive effect on stock returns. Price to book value (PBV) has a significant positive effect on stock returns.

Keywords : Inflasi, Earnings Per Share, Price to Book Value, Return Saham



UNIVERSITAS
MERCU BUANA