

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui bagaimana pengaruh antara ROI, EPS , dan DPS terhadap perubahan harga saham berkenaan dengan masalah untuk menentukan investasi dimasa yang akan datang.

Dalam penelitian ini data yang dibutuhkan adalah data sekunder . data yang digunakan adalah laporan keuangan berupa laporan laba/rugi PT.Indofood Sukses Makmur Tbk dari periode tahun 2001 s/d 2009, dan harga saham yang digunakan adalah harga saham closing price serta EPS yang positif. Data-data tersebut dianalisis menggunakan metode kausal dengan regresi linier berganda dan pengujian dilakukan dengan menguji secara simultan (F test) dan menguji secara parsial (T test). Pengolahan data dilakukan dengan bantuan program SPSS 17 for windows.

Hasil analisis menunjukkan bahwa secara simultan (bersama-sama) variabel independen berpengaruh secara signifikan terhadap variabel dependen sebesar 46,5% dan sisanya dipengaruhi oleh variable lain diluar model yang digunakan sebesar 53,5% .

Jika dilihat hasil analisis secara parsial tidak ada satu variable pun yang berpengaruh secara signifikan , artinya pada penelitian ini khususnya pada PT. Indofood Sukses Makmur Tbk. Para investor tidak melihat faktor yang digunakan dalam model ini dan diduga variabel lain yang digunakan investor untuk memprediksi perubahan harga saham pada PT.Indofood Sukses Makmur Tbk.

Kata kunci : *Return On Investment(ROI), Earning Per Share (EPS), dan Deviden Per Share(DPS)*

MERCU BUANA