

ABSTRAK

Investasi saham memerlukan pengamatan yang baik agar investasi saham yang dilakukan mencapai titik keuntungan maksimal. Banyaknya variabel penentu harga saham membuat para calon investor kesulitan dalam mengidentifikasi saham mana yang tepat dipilih untuk berinvestasi. Sehingga diperlukan reduksi variabel agar dapat membentuk suatu komponen utama tanpa menghilangkan informasi yang ada sebelumnya.

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui variabel apa saja yang menjadi pembentuk faktor utama dalam penentuan harga saham pada perusahaan berkode emiten HMSP, UNVR, KLBF, dan MLBI dengan menggunakan *Current Ratio*, *Quick Ratio*, *Debt to Equity Ratio*, *Debt to Asset Ratio*, *Total Asset Turnover*, *Inventory Turnover*, *Account Recieveables Turnover*, *Return on Assets*, *Net Profit Margin*, *Return on Equity*, *Operating Profit Margin*, *Earning Per Share*, *Book Value per Share*, *Net Income Growth Rate*, *Revenue Growth Rate*, *Earning per Share Growth Rate*, *Capital Market*, *Volume*, *Price*, *Price/Sales*, *Price/Book*, dan *Price to Earning Ratio* sebagai variabel bebas dan harga saham sebagai variabel terikat.

Penelitian ini menggunakan metode *Principal Component Analysis* untuk membentuk komponen baru penentu harga saham yang disebut dengan *principal component*. Data yang digunakan pada penelitian ini adalah data kinerja keuangan laporan keuangan masing-masing perusahaan secara triwulanan periode 2014-2018 di sektor industri barang konsumsi yang telah terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Berdasarkan hasil yang didapat dari penelitian ini, faktor utama penentu harga saham perusahaan berkode emiten HMSP yaitu *Price/Book*, QR, dan *Price*, faktor utama penentu harga saham perusahaan berkode emiten UNVR yaitu NPM, OPM, dan ROA, faktor utama penentu harga saham perusahaan berkode emiten MLBI yaitu EPS, ROA, dan *Capital Market*, faktor utama penentu harga saham perusahaan berkode emiten KLBF yaitu TATO, ROE, dan ROA.

Kata Kunci: Investasi, Harga Saham, *Principal Component Analysis*, Sektor Industri Barang Konsumsi