

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh Likuiditas, *Leverage* dan Profitabilitas terhadap perubahan harga saham perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia sejak tahun 2009 sampai dengan tahun 2011. Penelitian ini juga bertujuan untuk mendapatkan bukti empiris yang berpengaruh signifikan terhadap perubahan harga saham.

Data yang digunakan adalah laporan keuangan dari masing-masing perusahaan perbankan, yang dipublikasikan melalui website www.bei.co.id. Teknik pengambilan sampel yang digunakan adalah teknik *purposive sampling* dimana jumlah sampel yang diperoleh per tahun sebanyak 23 perusahaan, analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah metode kuantitatif, dengan pengujian asumsi klasik, serta analisis statistik yaitu analisis regresi linear berganda. Variabel penelitian ini adalah Likuiditas sebagai X_1 *Leverage* sebagai variabel X_2 , dan Profitabilitas sebagai variabel X_3 serta Perubahan Harga Saham sebagai Variabel Y.

Hasil penelitian ini adalah ketiga variabel independen berpengaruh positif terhadap Perubahan Harga Saham secara bersama-sama, tetapi secara parsial Likuiditas dan *Leverage* tidak berpengaruh terhadap Perubahan Harga saham, sedangkan Profitabilitas berpengaruh positif signifikan terhadap Perubahan Harga Saham.

Kata kunci: Likuiditas, *Leverage*, Profitabilitas, Perubahan Harga Saham