

## ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui pengaruh *return* saham, volume perdagangan, *varian return* saham dan harga saham terhadap *bid-ask spread*. Metode pengumpulan sampel dengan menggunakan *purposive sampling*, dengan jumlah sampel sebanyak 36 perusahaan. Metode analisis yang digunakan adalah asumsi klasik dan linear berganda.

Hasil penelitian yang didapatkan berdasarkan (uji t) diperoleh : (a) *return* saham berpengaruh positif dan signifikan terhadap *bid-ask spread* (b) volume perdagangan berpengaruh positif signifikan terhadap *bid-ask spread* (c) *varian return* saham berpengaruh positif dan signifikan terhadap *bid-ask spread* (d) harga saham berpengaruh positif dan signifikan terhadap *bid-ask spread*.

Akhirnya penulis menyarankan sebaiknya pihak perusahaan untuk memperhatikan faktor-faktor yang mempengaruhi *bid-ask spread*, seperti pengaruh *return* saham, volume perdagangan, *varian return* saham dan harga saham mampu memberikan pengaruh yang signifikan terhadap *bid-ask spread*.

**Kata Kunci:** *Return* saham, volume perdagangan, *varian return* saham, *bid-ask spread*