

ABSTRAK

ROZA, Nomor BP 15101155310733, Jurusan Manajemen “Pengaruh Harga Saham, *Varians Return* Saham dan Volume Perdagangan Saham Terhadap *Bid Ask Spread* (Studi Kasus Perusahaan Infrastruktur Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI)” dibawah bimbingan Dr.Ir. Zefriyenni,MM dan Pembimbing II Neni Sri Wahyuni Nengsi SE,MM.

Tujuan penelitian ini adalah untuk menganalisa analisis pengaruh harga saham, *varians return* saham dan volume perdagangan saham digunakan sebagai variabel Independen dan *Bid Ask Spread* sebagai variabel Dependen. Data yang digunakan adalah data sekunder berupa laporan keuangan dan *annual report* 2013 sampai 2017. Metode pengambilan sampel dilakukan dengan menggunakan *purpose sampling* dan metode analisis data yang digunakan adalah regresi data panel,Uji Asumsi Klasik, Uji hipotesis (Uji T, Uji F dan koefisien Determinasi) serta menggunakan alat bantu *Eviews9* untuk pengolahan data.

Hasil penelitan menunjukkan bahwa harga saham dan volume perdagangan saham secara parsial berpengaruh signifikan terhadap *bid ask spread*, dan *variansreturn* saham secara parsial tidak berpengaruh signifikan terhadap *bid ask spread*. Sedangkan secara simultan harga saham, *varians return* saham dan volume perdagangan saham berpengaruh signifikan terhadap *bid ask spread*, hasil penelitian ini menunjukkan hasil yang sejenis dengan penelitian yang dilakukan oleh Perdana dan Kristiani (2014), Diyang et, al (2017) dimana Harga Saham, *Varians Return* Saham dan Volume Perdagangan Saham berpengaruh signifikan terhadap *bid ask spread*. Adapun kontribusi Harga Saham, *Varians Return* Saham, dan Volume Perdagangan Saham terhadap *Bid Ask Spread* sebesar 4,5% sedangkan sisanya 95,5% dipengaruhi oleh variabel lain yang tidak diteliti.

Kata Kunci : *Bid Ask Spread*, Harga Saham, *Varians Return* Saham, Volume Perdagangan Saham