

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis pengaruh volume perdagangan saham, return saham, dan frekuensi perdagangan saham terhadap volatilitas harga saham pada perusahaan sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2022–2024. Penelitian ini menggunakan pendekatan kuantitatif dengan metode regresi data panel. Sampel penelitian terdiri dari 39 perusahaan yang dipilih menggunakan teknik purposive sampling dengan total 117 data observasi. Hasil penelitian menunjukkan bahwa volume perdagangan saham tidak berpengaruh signifikan terhadap volatilitas harga saham. Sebaliknya, return saham dan frekuensi perdagangan saham berpengaruh positif dan signifikan terhadap volatilitas harga saham. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa semakin tinggi return saham dan frekuensi perdagangan saham, maka semakin tinggi pula volatilitas harga saham. Penelitian ini diharapkan dapat menjadi bahan pertimbangan bagi investor dalam memahami faktor-faktor yang memengaruhi volatilitas harga saham pada sektor perbankan.

Kata Kunci: Volume Perdagangan Saham, *Return* Saham, Frekuensi Perdagangan Saham, Volatilitas Harga Saham.

ABSTRACT

This study aims to analyze the effect of stock trading volume, stock return, and trading frequency on stock price volatility in banking sector companies listed on the Indonesia Stock Exchange during the 2022–2024 period. This research employed a quantitative approach using panel data regression analysis. The sample consisted of 39 companies selected through purposive sampling, resulting in 117 observations. The findings reveal that stock trading volume has no significant effect on stock price volatility. In contrast, stock return and trading frequency have a positive and significant effect on stock price volatility. These results indicate that higher stock returns and trading frequency lead to higher stock price volatility. This study is expected to provide useful information for investors in understanding the factors affecting stock price volatility in the banking sector.

Keywords: Stock Trading Volume, Stock Return, Trading Frequency, Stock Price Volatility.