

**Pengaruh Cryptocurrency dan Nilai Tukar terhadap Harga Saham pada Sub Sektor
Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia**

ABSTRAK

**Oleh:
Shaennon Agustina
1962082**

**Dosen Pembimbing:
Dra. Rachyu Purbowati, MSA**

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh *cryptocurrency* dan nilai tukar terhadap harga saham pada sub sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Penelitian ini menggunakan data sekunder dimana data yang digunakan berupa *closing price* dari *cryptocurrency*, nilai tukar dan harga saham yang diperoleh melalui masing-masing *website*. Populasi penelitian ini adalah seluruh perusahaan sub sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Sampel yang digunakan dalam penelitian ini adalah perusahaan sub sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia dan tercantum pada laporan statistik tahunan yang diterbitkan Bursa Efek Indonesia periode 2020 - 2022. Total perusahaan yang menjadi sampel pada penelitian ini sejumlah 44 perusahaan dengan periode penelitian selama 3 tahun sehingga diperoleh 132 sampel. Metode penelitian menggunakan metode *purposive sampling*. Penelitian ini menggunakan regresi linier berganda untuk mengetahui pengaruh variabel independen terhadap variabel dependen. Hasil penelitian menunjukkan bahwa *cryptocurrency* dan nilai tukar berpengaruh negatif terhadap harga saham pada sub sektor perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Kata Kunci : *cryptocurrency*, nilai tukar, harga saham

The Effect of Cryptocurrency and Exchange Rates on Stock Prices in the Banking Sub-Sector Listed on the Indonesian Stock Exchange

ABSTRACT

By:

**Shaennon Agustina
1962082**

Supervisor:

Dra. Rachyu Purbowati, MSA

This study aims to determine the effect of cryptocurrency and exchange rates on stock prices in the banking sub-sector listed on the Indonesia Stock Exchange. This study uses secondary data where the data used is in the form of closing prices of cryptocurrencies, exchange rates and stock prices obtained through each website. The population of this study are all banking sub-sector companies listed on the Indonesia Stock Exchange. The sample used in this study is banking sub-sector companies listed on the Indonesia Stock Exchange and listed in the annual statistical report published by the Indonesia Stock Exchange for the period 2020 - 2022. The total number of companies that became the research sample was 44 companies with a research period of 3 years so that 132 samples were obtained. The research method uses a purposive sampling method. This study uses multiple linear regression to determine the effect of the independent variable on the dependent variable. The results of the study show that cryptocurrencies and exchange rates have a negative effect on stock prices in the banking sub-sector listed on the Indonesia Stock Exchange.

Keywords: cryptocurrency, exchange rates, stock prices