

**PENGARUH *CRYPTOCURRENCY*, *MARKET*
CAPITALIZATION DAN NILAI TUKAR TERHADAP HARGA
SAHAM PADA PERBANKAN YANG TERDAFTAR DI BURSA
EFEK INDONESIA TAHUN 2017 – 2021**

***THE EFFECT OF CRYPTOCURRENCIES, MARKET
CAPITALIZATION AND EXCHANGE RATE ON STOCK PRICES
IN BANK LISTED ON THE INDONESIA STOCK EXCHANGE IN
2017-2021***

Oleh

**Helfina Nozayani
2018420124**

SKRIPSI

Untuk memperoleh gelar sarjana dalam Ilmu Ekonomi Kosentrasi Akuntansi pada
Universitas Darma Persada



**PROGRAM SARJANA
FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS DARMA PERSADA
JAKARTA
2022**

LEMBAR PERSETUJUAN

Yang bertanda tangan dibawah ini :

Nama : Helfina Nozayani

NIM : 2018420124

Jurusan : Akuntansi

Peminatan : Keuangan

Judul Skripsi : **PENGARUH CRYPTOCURRENCY, MARKET CAPITALIZATION DAN NILAI TUKAR TERHADAP HARGA SAHAM PADA PERBANKAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2017 – 2021**


Telah diperiksa dan disetujui untuk diujikan dalam sidang Ujian Skripsi Sarjana
Tanggal


Jakarta, 12 Agustus 2022

Mengetahui,

Ketua Jurusan Akuntansi

Pembimbing


Dr. Atik Isnawati, S.E., Ak., M.si


Jombrik TPR, SE. MM

**PENGARUH *CRYPTOCURRENCY*, MARKET
CAPITALIZATION DAN NILAI TUKAR TERHADAP HARGA
SAHAM PADA PERBANKAN YANG TERDAFTAR DI BURSA
EFEK INDONESIA TAHUN 2017 – 2021**

***THE EFFECT OF CRYPTOCURRENCIES, MARKET
CAPITALIZATION AND EXCHANGE RATE ON STOCK PRICES
IN BANK LISTED ON THE INDONESIA STOCK EXCHANGE IN
(IDX) 2017-2021***

Oleh :
Helfina Nozayani
2018420124

SKRIPSI

Untuk memenuhi salah satu syarat ujian guna memperoleh gelar Sarjana dalam Ilmu
Ekonomi Program Studi Akuntansi pada Universitas Darma Persada

Telah disetujui oleh Tim Penguji pada tanggal

Seperti tertera dibawah ini

Jakarta, 12 Agustus 2022

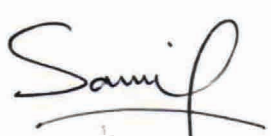
Pembimbing


Jombrik TPR, SE. MM

Penguji I

Penguji II


Oryza Sativa Heningtyas, S.E., M.Ak.


Saminem, SE., MBA

Dekan Fakultas Ekonomi

Ketua Jurusan Akuntansi


Mu'man Nuryana, Ph.D.


Dr. Atik Isnawati, S.E., Ak., M.Si

LEMBAR PERNYATAAN SKRIPSI

Yang bertanda tangan dibawah ini :

Nama : Helfina Nozayani

Nim : 2018420124

Jurusan/Peminatan : Akuntansi/ Keuangan

Dengan ini meyakini bahwa skripsi dengan judul **PENGARUH CRYPTOCURRENCY, MARKET CAPITALIZATION DAN NILAI TUKAR TERHADAP HARGA SAHAM PADA PERBANKAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2017-2021** yang dibimbing oleh Bapak Jombrik TPR, SE. MM adalah benar merupakan hasil karya saya sendiri dan bukan merupakan jiplakan maupun mengkopi hasil dari karya orang lain.

Apabila dikemudian hari ternyata tidak ditemukan ketidaksesuaian dengan pernyataan ini, maka saya bersedia mempertanggungjawabkannya. Demikian pernyataan ini saya buat dengan sesungguhnya tanpa ada paksaan dari pihak manapun.

Jakarta, 19 Agustus 2022

Yang menyatakan

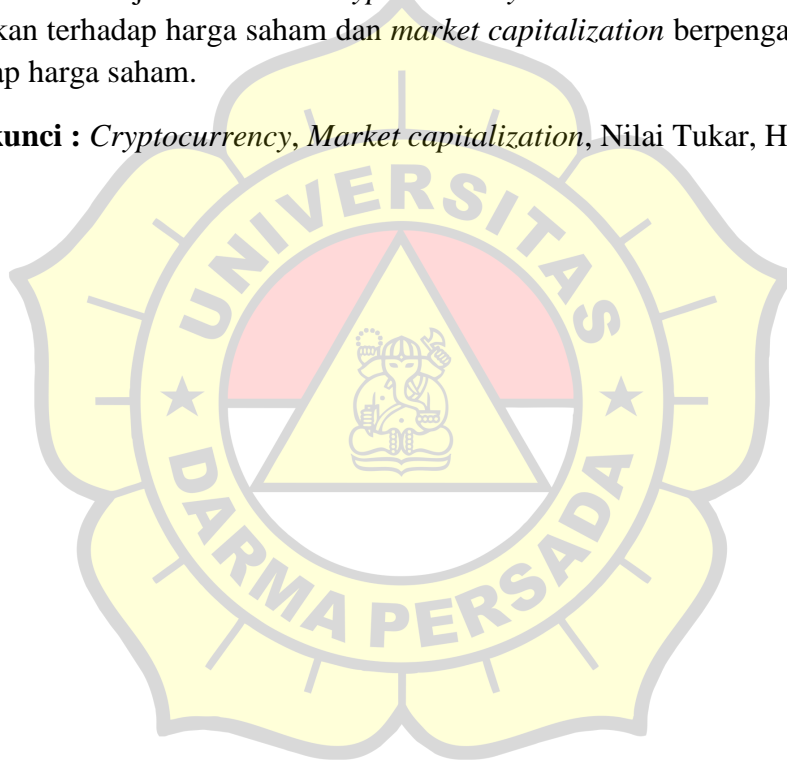


Helfina Nozayani

ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini untuk menguji pengaruh *cryptocurrency*, *market capitalization* dan nilai tukar terhadap harga saham. Penelitian ini dilakukan pada Perusahaan Perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) dengan periode data 2017-2021. Penelitian ini menggunakan metode penelitian kuantitatif dengan menggunakan data sekunder. Jumlah populasi dalam penelitian ini sebanyak 43 perusahaan dengan menggunakan metode *purposive sampling* dan diperoleh sampel sebanyak 38 perusahaan. Pengolahan data menggunakan regresi linear berganda. Alat yang digunakan dalam penelitian ini adalah SPSS versi 25. Hasil penelitian menunjukkan bahwa *cryptocurrency* dan nilai tukar tidak berpengaruh signifikan terhadap harga saham dan *market capitalization* berpengaruh signifikan terhadap harga saham.

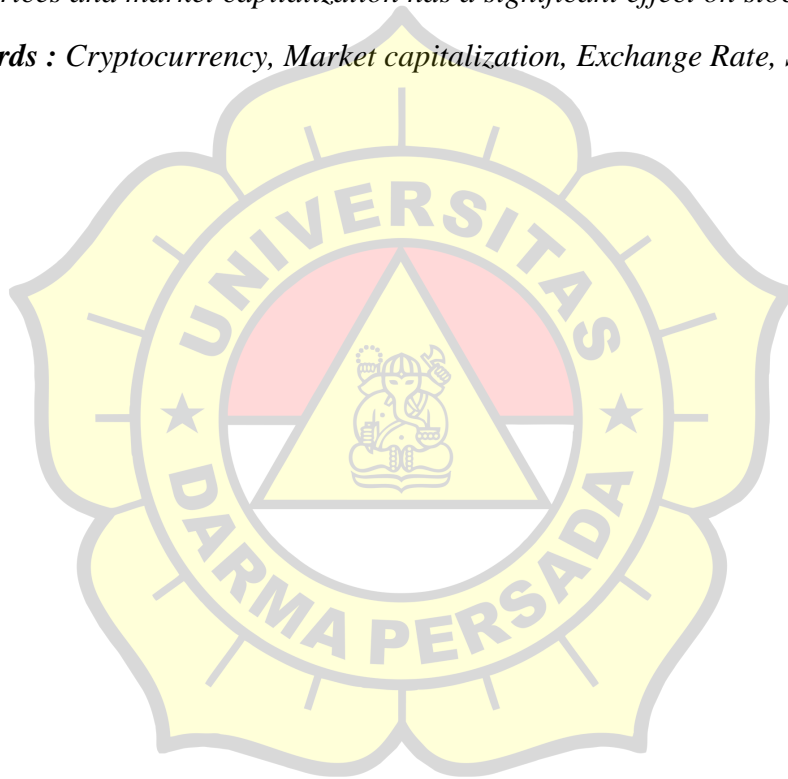
Kata kunci : *Cryptocurrency*, *Market capitalization*, Nilai Tukar, Harga Saham



ABSTRACT

The purpose of this study is to examine the effect of cryptocurrency, market capitalization and exchange rates on stock prices. This research was conducted on banking companies listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX) with a data period of 2017-2021. This study uses quantitative research methods using secondary data. The population in this study was 43 companies using purposive sampling method and 38 companies were obtained as samples. Data processing using multiple linear regression. The tool used in this study is SPSS version 25. The results show that cryptocurrency and exchange rates have no significant effect on stock prices and market capitalization has a significant effect on stock prices.

Keywords : *Cryptocurrency, Market capitalization, Exchange Rate, Stock Price*



KATA PENGANTAR

Segala puji dan syukur penulis panjatkan pada kehadiran Allah SWT yang Telah Melimpahkan Rahmat dan Karunianya serta hidayahnya, sehingga penulis dapat menyelesaikan penyusunan skripsi ini dengan judul “ **PENGARUH CRYPTOCURRENCY, MARKET CAPITALIZATION DAN NILAI TUKAR TERHADAP HARGA SAHAM PADA PERBANKAN YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2017 – 2021**”. Yang merupakan salah satu persyaratan untuk menyelesaikan program studi Strata Satu (S1) Jurusan Akuntansi Universitas Darma Persada.

Pada kesempatan kali ini penulis menyampaikan ucapan terimakasih yang sebanyak-banyaknya kepada semua pihak yang telah membantu dan membimbing baik secara langsung dalam proses penyusunan tugas akhir ini yang berupa saran dan kritik khususnya kepada :

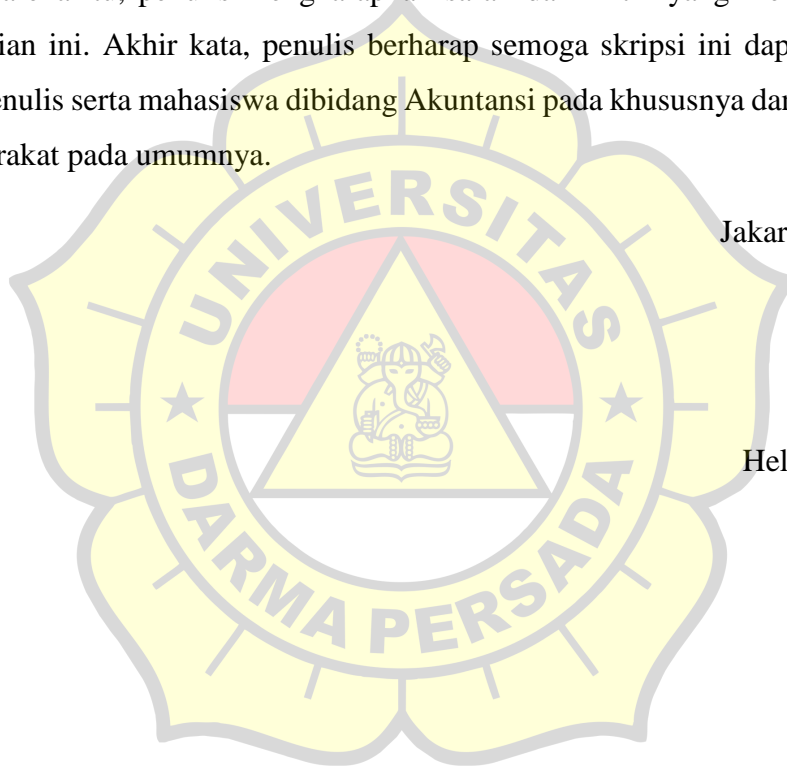
1. Kedua orang tua serta kakak saya yang selalu memberikan doa, semangat, nasihat dan motivasi serta dukungan yang tidak ternilai harganya.
2. Bapak Jombrik, SE, MM selaku Pembimbing skripsi saya yang dengan sabar memberikan saran, masukan, dan pemahaman ilmu dalam menyelesaikan skripsi ini. Terima kasih untuk tenaga, dan waktu yang telah bapak berikan kepada saya.
3. Ibu Dr. Atik Isnawati, S.E., Ak., M.Si. selaku ketua jurusan Akuntansi Fakultas Ekonomi Universitas Darma Persada yang telah memberikan masukan atau saran yang bermanfaat bagi penulis.
4. Bapak Reko Saprianto, SE., M.Si., Ak., CA., ACPA selaku Dosen Pembimbing Akademik Jurusan Akuntansi Fakultas Ekonomi Universitas Darma Persada Angkatan 2018 yang telah memberikan nasihat, motivasi serta saran kepada saya.
5. Bapak Mu'man Nuryana, Ph.D. selaku Dekan Fakultas Ekonomi Universitas Darma Persada.
6. Wahyu, Nanda, Noppay, Rara, Mentari, Cipe dan teman – teman semua yang telah membantu proses penyusunan skripsi ini.

7. Serta seluruh mahasiswa/i Jurusan Akuntansi Angkatan 2018 Fakultas Ekonomi Universitas Darma Persada yang senantiasa memberikan masukan positif demi terselesaikannya tugas ini.
8. Dan semua pihak yang tidak dapat disebutkan satu per satu dan yang telah membantu saya dalam penyelesaian skripsi dan kuliah saya dari awal sampai akhir.

Penulis sangat menyadari bahwa penulisan skripsi ini masih belum sempurna. Oleh karena itu, penulis mengharapkan saran dan kritik yang membangun bagi penelitian ini. Akhir kata, penulis berharap semoga skripsi ini dapat bermanfaat bagi penulis serta mahasiswa dibidang Akuntansi pada khususnya dan berguna bagi Masyarakat pada umumnya.

Jakarta, 2 Juli 2022

Helfina Nozayani



DAFTAR ISI

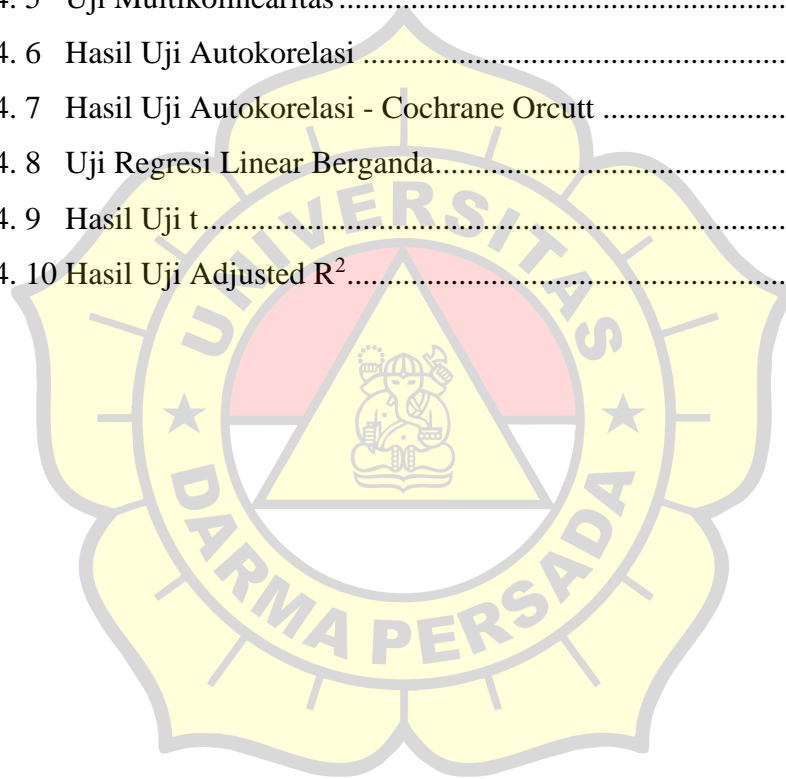
LEMBAR PERSETUJUAN	i
LEMBAR PERNYATAAN SKRIPSI	iii
ABSTRAK	iv
KATA PENGANTAR.....	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang Penelitian	1
1.2 Identifikasi, Pembatasan dan Rumusan Masalah	10
1.3 Tujuan Penelitian.....	12
1.4 Manfaat Penelitian.....	12
BAB II LANDASAN TEORI DAN KERANGKA PEMIKIRAN	14
2.1 Landasan Teori	14
2.2 Penelitian Sebelumnya	30
2.3 Kerangka Pemikiran dan Paradigma Penelitian	33
2.4 Hipotesis Penelitian.....	34
BAB III METODE PENELITIAN	36
3.1 Metode Yang Digunakan.....	36
3.2 Waktu dan Tempat Penelitian	37
3.3 Operasional Variabel	37
3.4 Populasi dan Sampel	39
3.5 Teknik Pengambilan Sampel.....	39
4.6 Sumber dan Cara Penentuan Data	40
4.7 Teknik Pengumpulan Data	41
4.8 Rancangan Analisis dan Uji Hipotesis	42
BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN.....	49
5.1 Gambaran Umum Obyek Penelitian.....	49
4.2 Analisis Statistik Deskriptif	51
4.3 Uji Asumsi Klasik	53

4.4	Analisis Regresi Linear Berganda.....	61
4.5	Uji Hipotesis.....	62
4.6	Pembahasan Penelitian.....	65
BAB V SIMPULAN DAN SARAN.....		68
5.1	Simpulan.....	68
5.2	Saran.....	69
DAFTAR PUSTAKA.....		71
LAMPIRAN.....		74



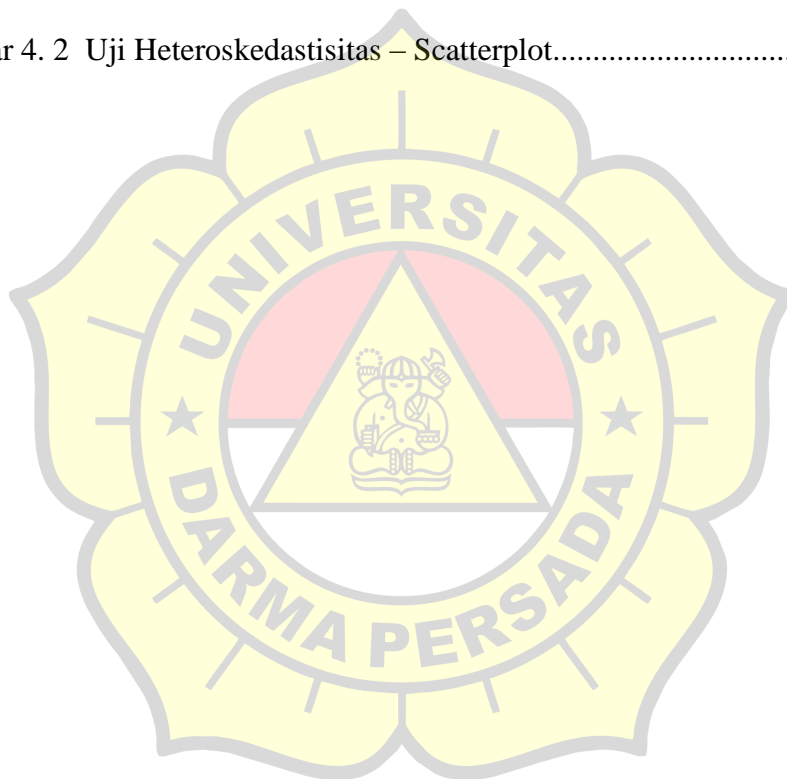
DAFTAR TABEL

Tabel 2. 1 Penelitian Terdahulu	30
Tabel 3. 1 Operasional Variabel	39
Tabel 4. 1 Pemilihan Sampel	50
Tabel 4. 2 Daftar Perusahaan Sampel	50
Tabel 4. 3 Stastik Deskriptif	52
Tabel 4. 4 Uji Normalitas - One-Sample Kolmogorov-Smirnov Test	55
Tabel 4. 5 Uji Multikolinearitas	56
Tabel 4. 6 Hasil Uji Autokorelasi	59
Tabel 4. 7 Hasil Uji Autokorelasi - Cochrane Orcutt	60
Tabel 4. 8 Uji Regresi Linear Berganda	61
Tabel 4. 9 Hasil Uji t	63
Tabel 4. 10 Hasil Uji Adjusted R ²	65



DAFTAR GAMBAR

Gambar 1. 1 Grafik nilai tukar tahun 2017-2021	9
Gambar 2. 1 Kerangka Pemikiran	33
Gambar 2. 2 Paradigma Penelitian	34
Gambar 4. 1 Uji Normalitas – P-plot	54
Gambar 4. 2 Uji Heteroskedastisitas – Scatterplot.....	58



DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1 Catatan Konsultasi Proposal Skripsi dan Skripsi	74
Lampiran 2 Daftar Perbankan Konvesional yang terdaftar di BEI Tahun 2017- 2021	76
Lampiran 3 Tabulasi Data Variabel Independen dan Dependen	78
Lampiran 4 Hasil Olah Data SPSS 25.....	89
Lampiran 5 Tabel DW	99
Lampiran 6 Tabel t	100
Lampiran 7 Daftar Riwayat Hidup.....	101
Lampiran 8 Catatan Atas Laporan Keuangan	102

