

ABSTRAK

PENGARUH *RETURN CRYPTOCURRENCY* DAN OLUME *CRYPTOCURRENCY* TERHADAP INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN

Oleh:

Ni Wayan Eka Afrilia

2112120040

yaneka3399@gmail.com

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan memberikan bukti empiris mengenai pengaruh *return cryptocurrency* dan volume *cryptocurrency* terhadap indeks harga saham gabungan. Penelitian ini merupakan penelitian kuantitatif. Sumber data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data sekunder. Metode pengumpulan data dalam penelitian ini menggunakan studi dokumentasi. Penelitian ini menggunakan data *cryptocurrency* dan IHSG dalam periode bulanan dari 1 Januari 2019 sampai 31 Desember 2023, dengan total data sebanyak 180. Teknik pengambilan sampel yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan teknik *purposive sampling*. Metode analisis data dan pengujian hipotesis yang digunakan adalah analisis linear berganda dengan alat analisis SPSS V.26. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa *return cryptocurrency* memiliki pengaruh signifikan terhadap Indeks Harga Saham Gabungan. Namun, volume *cryptocurrency* tidak memiliki pengaruh signifikan terhadap Indeks Harga Saham Gabungan.

Kata kunci : *Return Cryptocurrency*, *Volume Cryptocurrency*, IHSG

ABSTRACT

THE EFFECT OF RETURN CRYPTOCURRENCY AND VOLUME CRYPTOCURRENCY ON THE COMPOSITE STOCK PRICE INDEX

By :

NI WAYAN EKA AFRILIA

2112120040

yaneka3399@gmail.com

This study aimed to test and provide empirical evidence regarding the effect of cryptocurrency returns and cryptocurrency volume on the composite stock price index. This study was quantitative research. The data sources used in this study were secondary data. The data collection method in this study used documentary research. This study used cryptocurrency and IHSG data on a monthly basis from 1 January 2019 to 31 December 2023, with a total of 180 data points. The sampling technique employed purposive sampling. The data analysis and hypothesis testing methods used was multiple linear regression analysis with the SPSS V.26 analysis tool. The results of this study indicated that cryptocurrency returns had a significant influence on the Composite Stock Price Index. However, cryptocurrency volume did not significantly affect the Composite Stock Price Index.

Keywords : *Return Cryptocurrency, Volume Cryptocurrency, IHSG*