

LAPORAN SKRIPSI

**ANALISIS PERBANDINGAN KINERJA INVESTASI
CRYPTOCURRENCY ETHEREUM, VALUTA ASING, DAN EMAS
DENGAN PERHITUNGAN *RISK*, *RETURN*, DAN INDEKS *SHARPE*
(PERIODE TAHUN 2020-2023)**



Nama : Michelle Laura Mulyono

Nim : 20.D1.0209

**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA SEMARANG
2024**

**ANALISIS PERBANDINGAN KINERJA INVESTASI
CRYPTOCURRENCY ETHEREUM, VALUTA ASING, DAN EMAS
DENGAN PERHITUNGAN *RISK*, *RETURN*, DAN INDEKS *SHARPE*
(PERIODE TAHUN 2020-2023)**

SKRIPSI

Diajukan untuk memenuhi syarat guna mencapai gelar Sarjana
pada Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis
Universitas Katolik Soegijapranata



Nama : Michelle Laura Mulyono

Nim : 20.D1.0209

Dosen Pembimbing :

Dra. Lucia Hari P, MSi

**PROGRAM STUDI MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS KATOLIK SOEGIJAPRANATA SEMARANG
2024**

ABSTRAK

Pada era globalisasi ini banyak terjadi pertumbuhan di bidang teknologi maupun pada bidang lainnya. Pertumbuhan ini berpengaruh terhadap segala aspek kehidupan manusia. Manusia pada masa ini diharuskan untuk belajar kembali dan berkembang untuk beradaptasi mengikuti *trend* yang ada. Kita tidak hanya membutuhkan dana untuk jangka panjang tetapi kita juga pastinya membutuhkan dana untuk jangka pendek. Untuk mendapatkan dana ini banyak orang yang memulai dengan berinvestasi. Banyaknya jenis investasi pastinya akan membuat investor bingung untuk memilih investasi yang tepat. Sehingga investor harus dengan teliti untuk membandingkan investasi satu dengan lain yang dianggap untung pada masa ini. Untuk itu peneliti melakukan studi kasus dengan topik ini untuk membantu calon investor dalam menentukan investasi yang akan mereka pilih.

Atas dasar pemikiran tersebut penelitian ini dibuat dengan tujuan untuk membandingkan kinerja investasi *Cryptocurrency Ethereum*, Valuta Asing, dan Emas menggunakan perhitungan risk, return, dan indeks Sharpe. Penelitian ini menggunakan data sekunder harga penutupan bulanan yang diperoleh melalui website Investing.com periode tahun 2020-2023. Penelitian ini dilakukan dengan menggunakan analisis uji Deskriptif, uji Asumsi Klasik, dan uji Hipotesis menggunakan uji *Kruskal Wallis*. Hasil dari uji tersebut adalah 1) Tidak terdapat perbedaan yang signifikan pada return *Cryptocurrency Ethereum*, Valuta Asing, dan Emas 2) Terdapat perbedaan yang signifikan pada risiko *Cryptocurrency Ethereum*, Valuta Asing, dan Emas 3) Terdapat perbedaan yang signifikan pada nilai *Sharpe* kinerja investasi *Cryptocurrency Ethereum*, Valuta Asing, dan Emas.

Kata Kunci : *Cryptocurrency Ethereum*, Valuta Asing, USD, Emas, Investasi, Kinerja, Return, Risk, Indeks *Sharpe*