

ABSTRAK

Investasi Merupakan Instrumen yang menjanjikan dalam meningkatkan pendapatan bagi setiap orang yang akan menginvestasikan uangnya, Banyak berbagai Instrumen Investasi yang kita temuin seperti saham, Cryptocurrency, Emas, Foregin exchange (Valas), dan lain sebagainya, akan tetapi investasi mempunya resiko dan pengembalian hasil dari setiap instrument yang akan di investasikan. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui analisis perbandingan investasi pada foreign exchange (eurousd), bitcoin, saham (Lq45) dari tahun 2017 – 2021 yaitu sebanyak 240 data. Teknik pengambilan sample pada penelitian ini adalah teknik pengambilan jenuh. Metode analisis yang di gunakan metode komparatif dan data yangdigunakan adalah data sekunder Data dikalkulasikan dengan menggunakan program *Microsoft Excel* berdasarkan formula dari masing-masing variabel. Data diolah secara statistic menggunakanaplikasi SPSS, yaitu Uji Kruskall-Wallis. Hasil penelitian menunjukkan bahwa tidak ada perbedaan yang signifikan untuk return dari *Foreign Exchange*, Bitcoin, Saham LQ45, dan Emas. Kemudian, hasil penelitian menunjukkan bahwa terdapat perbedaan yang signifikan untuk Risiko dari *Foreign Exchange*, Bitcoin, Saham LQ45, dan Emas. Berdasarkan metode Sharpe, Treynor dan Jensen terdapat perbedaan yang nyata atau signifikan untuk kinerja yang diukur dengan metode Sharpe dari *Foreign Exchange*, Bitcoin, Saham LQ45, dan Emas

Kata Kunci: Investasi, perbandingan, *foreign exchange*, Bitcoin, Saham, emas, resiko, return

UNIVERSITAS
MERCU BUANA

ABSTRACT

Investment is an instrument that promises to increase income for everyone who will invest their money. There are many investment instruments that we find such as stocks, cryptocurrencies, gold, foreign exchange (forex), and so on, but investments have risks and returns from each investment instrument to be invested. This study aims to find out a comparative analysis of investments in foreign exchange (eurosd), bitcoin, stocks (Lq45) from 2017 – 2021, namely 240 data. The sampling technique in this study is the saturation technique. The analytical method used is the comparative method and the data used is secondary data. The data is calculated using the Microsoft Excel program based on the formula of each variable. The data is statistically processed using the SPSS application, namely the Kruskal-Wallis test. The research results show that there is no significant difference in returns from Foreign Exchange, Bitcoin, LQ45 Shares, and Gold. Then, the research results show that there are significant differences in the risks of foreign exchange, Bitcoin, LQ45 shares and gold. Based on the Sharpe, Treynor and Jensen methods, there are real or significant differences in the performance measured by the Sharpe method from Foreign Exchange, Bitcoin, LQ45 Stocks, and Gold

Keywords: *Investment, comparison, foreign exchange, Bitcoin, stocks, gold, risk, return*

