

**ANALISIS VOLATILITAS *RETURN* INDEKS SAHAM
KONVENSIONAL DENGAN INDEKS SAHAM SYARIAH
SEBELUM DAN SEMASA PANDEMI COVID-19:
PENDEKATAN GARCH**

TESIS



Oleh

**RASTRA AYU NOVIAWATI
128508203027**

**PASCASARJANA
PROGRAM MAGISTER EKONOMI SYARIAH
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI SAYYID ALI
RAHMATULLAH TULUNGAGUNG
JULI 2022**

**ANALISIS VOLATILITAS *RETURN* INDEKS SAHAM
KONVENSIONAL DENGAN INDEKS SAHAM SYARIAH
SEBELUM DAN SEMASA PANDEMI COVID-19:
PENDEKATAN GARCH**

TESIS

Disusun dalam rangka untuk memenuhi salah satu persyaratan
Menempuh Program Magister (S2)
Ekonomi Syariah
Pascasarjana UIN Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung



Oleh

**RASTRA AYU NOVIAWATI
128508203027**

**PASCASARJANA
PROGRAM MAGISTER EKONOMI SYARIAH
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI SAYYID ALI
RAHMATULLAH TULUNGAGUNG
JULI 2022**

PERNYATAAN KEASLIAN

Yang bertanda tangan di bawah ini saya:

Nama : Rastra Ayu Noviawati
NIM : 128508203027
Program Studi : Ekonomi Syariah
Institusi : UIN Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung

Dengan sungguh-sungguh menyatakan bahwa TESIS yang berjudul "*Analisis Volatilitas Return Indeks Saham Konvensional Dengan Indeks Saham Syariah Sebelum dan Semasa Pandemi COVID-19: Pendekatan GARCH*" ini secara keseluruhan adalah hasil pikiran atau karya saya sendiri kecuali pada bagian-bagian yang dirujuk sumbernya.

Tulungagung, 22 Juli 2022



Saya yang menyatakan



Rastra Ayu Noviawati
NIM. 128508203027





PERSETUJUAN PEMBIMBING

Tesis dengan judul "*Analisis Volatilitas Return Indeks Saham Konvensional Dengan Indeks Saham Syariah Sebelum dan Semasa Pandemi COVID-19: Pendekatan GARCH*" yang ditulis oleh Rastra Ayu Noviawati, NIM. 128508203027 ini telah diperiksa dan disetujui untuk diujikan.

Dosen Pembimbing	Tanggal	Tanda Tangan
Pembimbing 1, <u>Prof. Dr. Agus Eko Sujianto, S.E., M.M.</u> NIP. 197108072005011003	12 Juli 2022	
Pembimbing 2, <u>Dr. Binti Nur Asiyah, M.Si.</u> NIP. 198008112011012007	12 Juli 2022	

PENGESAHAN

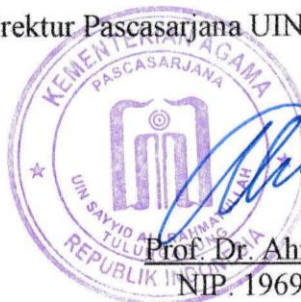
Tesis dengan judul “Analisis Volatilitas *Return* Indeks Saham Konvensional Dengan Indeks Saham Syariah Sebelum dan Semasa Pandemi COVID-19: Pendekatan GARCH” yang ditulis oleh Rastra Ayu Noviawati ini telah dipertahankan di depan Dewan Penguji Tesis Pascasarjana Universitas Islam Negeri (UIN) Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung pada hari Jum’at tanggal 22 Juli 2022 dan diterima sebagai salah satu persyaratan untuk memperoleh gelar Magister Ekonomi Syariah.


Dewan Penguji	Tanda Tangan
Ketua Penguji <u>Prof. Dr. Agus Eko Sujianto, S.E., M.M.</u> NIP. 197108072005011003	
Sekretaris Penguji <u>Dr. Binti Nur Asiyah, M.Si.</u> NIP. 198008112011012007	
Penguji I <u>Dr. Kutbuddin Aibak, S.Ag., M.H.I.</u> NIP. 197707242003121006	
Penguji II <u>Dr. H. Dede Nurrohman, M.Ag.</u> NIP. 197112182002121003	

Tulungagung, 22 Juli 2022

Mengetahui,

Plh. Direktur Pascasarjana UIN Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung




Prof. Dr. Ahmad Tanzeh, M.Pd.I
NIP. 196912061999031003



**KEMENTERIAN AGAMA REPUBLIK INDONESIA
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI
SAYYID ALI RAHMATULLAH TULUNGAGUNG
UPT PERPUSTAKAAN**

Jalan Mayor Sujadi Timur Nomor 46 Tulungagung - Jawa Timur 66221
Telepon (0355) 321513, Website : <http://perpustakaan.uinsatu.ac.id>

SURAT PERNYATAAN KESEDIAAN PUBLIKASI KARYA ILMIAH

Saya yang bertanda tangan di bawah ini:

Nama : RASTRA AYU NOVIAWATI
NIM : 128508203027
Jurusan : EKONOMI SYARIAH
Fakultas : PASCASARJANA
Jenis Karya Ilmiah : TESIS

Demi pengembangan ilmu pengetahuan, menyetujui untuk memberikan Hak Bebas Royalti Non-eksklusif (Non-exclusive Royalty-Free Right) kepada UPT Perpustakaan UIN Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung atas karya ilmiah saya berupa (TESIS...) yang berjudul:

ANALISIS VOLATILITAS RETURN INDEKS SAHAM KONVENSIONAL
DENGAN INDEKS SAHAM SYARIAH SEBELUM DAN SEMASA
PANDEMI COVID-19: PENDEKATAN GARCH

Dengan Hak Bebas Royalti Non-eksklusif ini UPT Perpustakaan UIN Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung berhak menyimpan, alih media/format, mengelola dalam bentuk pangkalan data (*database*), merawat, dan mempublikasikan tugas akhir saya selama tetap mencantumkan nama saya sebagai penulis/pencipta dan sebagai pemilik Hak Cipta.

Demikian pernyataan ini saya buat untuk dapat dipergunakan sebagaimana mestinya.

Tulungagung, 12 September 2023
Yang Menyatakan,


RASTRA AYU N.