

**PENERAPAN MODEL GARCH DALAM PERAMALAN
VOLATILITAS *RETURN* INDEKS SAHAM ASIA TAHUN
2004-2024**

SKRIPSI



Oleh
Candra Rahmat Hadi
NIM. 1860406222079

**PROGRAM STUDI
MANAJEMEN KEUANGAN SYARIAH
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS ISLAM
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI SAYYID ALI RAHMATULLAH
TULUNGAGUNG
JANUARI 2026**

**PENERAPAN MODEL GARCH DALAM PERAMALAN
VOLATILITAS *RETURN* INDEKS SAHAM ASIA TAHUN
2004-2024**

SKRIPSI

Disusun dalam rangka untuk memenuhi salah satu persyaratan
menempuh program Sarjana (S1)
Manajemen Keuangan Syariah
Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung




Oleh
Candra Rahmat Hadi
NIM. 1860406222079

**PROGRAM STUDI
MANAJEMEN KEUANGAN SYARIAH
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS ISLAM
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI SAYYID ALI RAHMATULLAH
TULUNGAGUNG
JANUARI 2026**


PERSETUJUAN PEMBIMBING

Skripsi dengan judul “Penerapan Model Garch Dalam Peramalan Volatilitas *Return* Indeks Saham Asia Tahun 2004-2024” yang ditulis oleh Candra Rahmat Hadi, NIM 1860406222079 telah diperiksa dan disetujui untuk diujikan.

Promotor/Pembimbing	Tanggal	Tanda Tangan
<u>Mega Tunjung Hapsari, M.AP.</u> NIP. 199312112019032028	24 Desember 2025	

Mengetahui,

Koorprodi Manajemen Keuangan Syariah



Ahmad Syaichoni, M. Sy
NIP. 199101222018011002

PENGESAHAN

Skripsi dengan judul “Penerapan Model GARCH Dalam Peramalan Volatilitas Return Indeks Saham Asia Tahun 2004-2024” yang ditulis oleh Candra Rahmat Hadi ini telah dipertahankan di depan Dewan Penguji Skripsi UIN Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung pada hari Kamis tanggal 15 Januari 2026 dan diterima sebagai salah satu persyaratan untuk memperoleh gelar Sarjana Manajemen Keuangan Syariah.

DEWAN PENGUJI

Dewan Penguji

Tanda Tangan

Ketua Penguji:

Mega Tunjung Hapsari, M.AP.
NIP. 199312112019032028


.....


Penguji Utama:

Dr. Muhamad Aqim Adlan, S.Ag., S.Pd., M.E.I
NIP. 197404162008011008


.....

Sekretaris:

Dedi Suselo, S.E., M.M.
NI PPPK. 199005232023211028


.....

Mengesahkan,

Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam
Universitas Islam Negeri Sayyid Ali Rahmatullah Tulungagung



Prof. Dr. Chusail Cholimah, M.Ag.
NIP. 195202122001

PERNYATAAN KEASLIAN TULISAN

Saya yang bertanda tangan di bawah ini:

Nama : Candra Rahmat Hadi

NIM : 1860406222079

Jurusan/Prodi : Jurusan Bisnis dan Manajemen Prodi Manajemen
Keuangan Syariah

Fakultas : Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam

Menyatakan dengan sesungguhnya bahwa Skripsi yang saya tulis ini benar-benar tulisan saya dan bukan merupakan plagiasi baik sebagian atau seluruhnya. Apabila di kemudian hari terbukti atau dapat dibuktikan bahwa skripsi ini hasil plagiasi, baik sebagian atau seluruhnya, maka saya bersedia menerima sanksi atas perbuatan tersebut sesuai dengan ketentuan yang berlaku.

Tulungagung, 24 Desember 2025

Saya yang menyatakan



Candra Rahmat Hadi
NIM. 1860406222079



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 : Candra Rahmat Hadi
NIM : 1860406222079
Jurusan : Manajemen Keuangan Syariah
Fakultas : Ekonomi dan Bisnis Islam
Jenis Karya Ilmiah : Skripsi

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 (Skripsi) yang berjudul:

Penerapan Model GARCH Dalam Peramalan Volatilitas Return Indeks Saham Asia Tahun 2004 - 2024

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, 19 Januari 2026
Yang Menyatakan,



CANDRA RAHMAT HADI
Nama terang dan tanda tangan