

**PENGARUH INDEKS SAHAM REGIONAL TERHADAP
VOLATILITAS INDEKS *JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII)* DAN
INDEKS *SUSTAINABLE RESPONSIBLE INVESTMENT (SRI)*-
KEHATI PERIODE 2015 - 2019**

SKRIPSI


*Diajukan sebagai Salah Satu Syarat untuk Mencapai Gelar Sarjana
Pada Program Studi S1 Jurusan Manajemen Fakultas Ekonomi
Universitas Andalas*



Dosen Pembimbing:

**Fajri Adrianto, S.E., M.Bus
(Adv), Ph.D**

**PROGRAM STUDI S1 JURUSAN
MANAJEMEN FAKULTAS EKONOMI
UNIVERSITAS ANDALAS
PADANG
2021**

	No. Alumni Universitas	Camilla Listira Luqyana	No. Alumni Fakultas
	a) Tempat/tgl lahir: Jakarta, 5 April 2000 b) Nama Orang Tua: Mukhlis dan Oktinuzufa c) Fakultas Ekonomi d) Jurusan Manajemen e) No.BP: 1710523035 f) Tanggal Lulus: 26 Juni 2021 g) Predikat Lulus: Dengan Pujian h) IPK: 3,80 i) Lama Studi: 3 tahun 11 bulan j) Alamat Orang Tua: Perumahan Mampang Hills, Jalan Gardenia II No. 12, Depok, Jawa Barat.		

PENGARUH INDEKS SAHAM REGIONAL TERHADAP VOLATILITAS INDEKS JAKARTA ISLAMIC INDEX (JII) DAN SUSTAINABLE RESPONSIBLE INVESTMENT (SRI)-KEHATI PERIODE 2015 - 2019

Skripsi oleh: Camilla Listira Luqyana

Pembimbing: Fajri Adrianto, S.E., M.Bus (Adv), Ph.D

ABSTRAK

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui pengaruh indeks saham regional Asia terhadap volatilitas pengembalian (*return*) saham indeks *Jakarta Islamic Index* (JII) dan *Sustainable Responsible Investment* (SRI)-KEHATI. Dalam penelitian ini menggunakan data *return* harian pada tahun 2015 sampai 2019. Analisis data yang digunakan dalam penelitian ini menggunakan metode GARCH (1,1). Hasil penelitian menunjukkan bahwa indeks regional Asia berpengaruh terhadap volatilitas *return* saham JII namun tidak memiliki pengaruh signifikan terhadap volatilitas indeks SRI-KEHATI.

Kata Kunci: *Volatilitas Pengembalian Saham, Indeks Saham Regional, GARCH*


Skripsi telah dipertahankan didepan sidang penguji dan dinyatakan lulus pada tanggal: 26 Juni 2021.

Abstrak telah disetujui oleh :

Tanda Tangan	1. 	2. 	3. 
Nama Terang	Fajri Adrianto, S.E., M.Bus (Adv), Ph.D	Masyhuri Hamidi, S.E., M.Si, CFP, Ph.D	Mohammad Fany Alfarisi, S.E., MS. Fin, Ph.D

Mengetahui,
Ketua Jurusan Manajemen

Hendra Lukito, SE,MM,Ph.D
NIP. 197106242006041007


Tanda Tangan

Alumnus telah mendaftar ke fakultas/universitas dan mendapat nomor alumnus :

	Petugas Fakultas/Universitas	
No. Alumni Fakultas	Nama	Tanda Tangan
No. Alumni Universitas	Nama	Tanda Tangan