

**PENGARUH VOLATILITAS NILAI TUKAR TERHADAP VOLATILITAS
INDEKS SEKTORAL SAHAM SYARIAH INDONESIA**

SKRIPSI

**DIAJUKAN UNTUK MEMENUHI SEBAGIAN PERSYARATAN DALAM
MEMPEROLEH GELAR
SARJANA EKONOMI ISLAM**



Oleh:

**NANDA LISMATIARA ZUBAID
NIM. 041611433085**

PROGRAM STUDI S1 EKONOMI ISLAM

FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS

UNIVERSITAS AIRLANGGA

SURABAYA

2020

**THE EFFECT OF EXCHANGE RATE VOLATILITY ON INDONESIA'S
SHARIA STOCK SECTORAL INDEX VOLATILITY**

THESIS

**SUBMITTED IN PARTIAL FULFILLMENT OF THE
REQUIREMENTS FOR THE DEGREE OF
BACHELOR OF ISLAMIC ECONOMICS**



**By:
NANDA LISMATIARA ZUBAID
NIM. 041611433085**

**ISLAMIC ECONOMICS STUDY PROGRAM
FACULTY OF ECONOMICS AND BUSINESS
UNIVERSITAS AIRLANGGA**

SURABAYA

2020

SKRIPSI
PENGARUH VOLATILITAS NILAI TUKAR TERHADAP
VOLATILITAS INDEKS SEKTORAL SAHAM SYARIAH INDONESIA

DIAJUKAN OLEH:
NANDA LISMATIARA ZUBAID
NIM: 041611433085

TELAH DISETUJUI DAN DITERIMA DENGAN BAIK OLEH

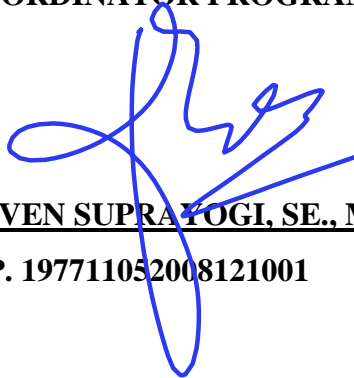
DOSEN PEMBIMBING,



SULISTYA RUSGIANTO, SE., MIF., Ph.D TANGGAL 11 September 2020

NIP. 197111012006041002

KOORDINATOR PROGRAM STUDI,



NOVEN SUPRAYOGI, SE., M.Si., Ak. TANGGAL 18 September 2020

NIP. 197711052008121001

PERNYATAAN ORISINALITAS SKRIPSI

Saya, (Nanda Lismatiara Zubaid, 041611433085), menyatakan bahwa:

1. Skripsi saya ini adalah asli dan benar-benar hasil karya saya sendiri, dan bukan hasil karya orang lain dengan mengatas namakan saya, serta bukan merupakan hasil peniruan atau penjiplakan (*plagiarism*) dari karya orang lain. Skripsi ini belum pernah diajukan untuk mendapat gelar akademik baik di Universitas Airlangga maupun di perguruan tinggi lainnya.
2. Dalam skripsi ini tidak terdapat karya atau pendapat yang telah ditulis atau dipublikasikan orang lain, kecuali secara tertulis dengan jelas dicantumkan sebagai acuan dengan disebutkan nama pengarang dan dicantumkan dalam daftar kepustakaan.
3. Pernyataan ini saya buat dengan sebenar-benarnya, dan apabila dikemudian hari terdapat penyimpangan dan ketidakbenaran dalam pernyataan ini, maka saya bersedia menerima sanksi akademik berupa pencabutan gelar yang telah diperoleh karena karya tulis skripsi ini, serta sanksi-sanksi lainnya sesuai dengan norma dan peraturan yang berlaku di Universitas Airlangga.

Surabaya, 10 Agustus 2020



Nanda Lismatiara Zubaid
NIM 041611433085

DECLARATION

I, (Nanda Lismatiara Zubaid, 041611433085), declare that :

1. My thesis is genuine and truly my own creation, and creation is not another's person work made under my name and not a piracy or plagiarism. This thesis has never been submitted to obtain an academic degree in Airlangga University or in any other Universities/colleges.
2. Thus thesis does not contain any work or opinion writer or published by others, except in writing clearly listed as a reference to author's name is mentioned and included in the list of literature.
3. This statement I make with truth and if in the future there are irregularities and untruth in this statement, the I am willing to accept academic sanction of revocation of degrees earned for writing this essay, as well as imposing other sanctions as provided by law at the University of Airlangga.

Surabaya, August 10th 2020



Nanda Lismatiara Zubaid
041611433085

KATA PENGANTAR

Syukur Alhamdulillah terpanjatkan kepada Allah Subhanahu wata'ala yang telah melimpahkan rahmat dan hidayah-Nya serta pertolongan-Nya sehingga skripsi yang berjudul “Pengaruh Volatilitas Nilai Tukar terhadap Volatilitas Indeks Sektoral Saham Syariah” dapat terselesaikan untuk memenuhi sebagian syarat untuk memperoleh gelar sarjana ekonomi islam di Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga. Skripsi ini tidak dapat terwujud tanpa banyaknya bantuan dan dukungan dari berbagai pihak. Pada kesempatan ini penulis ingin mengucapkan terimakasih kepada Sulistya Rusgianto, SE., MIF., Ph.D yang telah meluangkan waktunya dan memberikan bimbingan, saran, dan nasehatnya dengan penuh kesabaran untuk menyelesaikan skripsi ini. Dalam kesempatan ini penulis juga mengucapkan terima kasih kepada:

1. Ayah, ibu, ao, ibong, dan seluruh keluarga penulis yang selalu memberikan doa dan dukungan untuk kelancaran skripsi ini.
2. Prof. Dr. Hj. Dian Agustia , SE., M.Si., Ak. selaku Dekan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Airlangga, Prof. Dr. Raditya Sukmana, S.E., MA., selaku Ketua Departemen Ekonomi Syariah, Noven Suprayogi, S.E,M.Si.,Ak., selaku Ketua Program Studi Ekonomi Islam, juga Dr. Atina Shofawati, S.E., M.Si., selaku dosen wali, seluruh Akademisi, Staf Pengajar dan Staf Administrasi Fakultas Ekonomi dan Bisnis dan Departemen Ekonomi Syariah Universitas Airlangga atas segala ilmu selama perkuliahan dan penulisan skripsi.
3. Teman-teman Ekis Unair 2016 khususnya Ulis, Prilo, Andita, Larasayu, Dhila, Himma, Shela, Pea, Ira, Dea, Fajar, Caca, dan Tata yang telah berjuang bersama melewati masa-masa perkuliahan. Serta teman-teman lainnya yaitu Afif, Bima, Meyda, Rizka, Novita, Zulfa, Dewi dan keluarga besar Trip Bude khususnya Diah, Nindya, Aisyah, Agnes, Fitri, Alif, Septiyan, Nara, Hanif, Febrian, Ferdinan dan saudara-saudari lainnya yang tiada henti memberikan motivasi dan semangat bagi penulis.
4. Semua pihak yang tidak dapat disebutkan satu per satu oleh penulis.

Penulis menyadari begitu banyak ketidaksempurnaan dalam skripsi ini, oleh karenanya penulis mengharapkan adanya kritik dan sarang yang membangun agar skripsi ini bisa lebih baik. Semoga skripsi ini dapat memberikan manfaat bagi banyak orang.

Surabaya, 10 Agustus 2020

Nanda Lismatiata Zubaid