

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN I.....	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR.....	xi
DAFTAR LAMPIRAN	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	6
1.3 Batasan Masalah	6
1.4 Tujuan Penelitian	7
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	8
2.1 Minyak Mentah.....	8
2.2 Peramalan.....	8
2.3 Analisis Runtun Waktu	9
2.4 Stasioneritas	9
2.4.1 Stasioneritas dalam Varian.....	10
2.4.2 Stasioneritas dalam <i>Mean</i>	13
2.5 Fungsi Autokorelasi dan Autokorelasi Parsial	15
2.5.1 <i>Autocorrelation Function</i> (ACF)	15
2.5.2 <i>Partial Autocorrelation Function</i> (PACF)	17
2.6 Model Runtun Waktu Stasioner.....	18
2.6.1 Model <i>Autoregressive</i> (AR).....	18
2.6.2 Model <i>Moving Average</i> (MA).....	19
2.6.3 Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA).....	20

2.7	Model Runtun Waktu Non Stasioner.....	20
2.7.1	Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA).....	20
2.7.2	Model <i>Autoregressive Fractionally Integrated Moving</i> <i>Avarage</i> (ARFIMA).....	22
2.8	Prosedur Pemodelan ARFIMA.....	23
2.8.1	Identifikasi Pola <i>Long Memory</i>	23
2.8.2	Estimasi Parameter Pembeda (<i>d</i>) dengan metode Geweke Porter-Hudak (GPH).....	24
2.8.3	Estimasi Parameter Model ARFIMA (<i>p, d, q</i>).....	26
2.9	Uji Signifikansi Parameter Model.....	29
2.10	Uji Diagnostik Model.....	30
2.10.1	Uji Normalitas Residual.....	31
2.10.2	Uji Independensi Residual (<i>White Noise</i>).....	31
2.10.3	Uji Homoskedastisitas Residual.....	32
2.11	Model Terbaik.....	34
2.12	Model <i>Generalized Autoregressive Condotional Heteroskedasticity</i> (GARCH).....	34
2.12.1	Estimasi Parameter GARCH.....	35
2.13	Evaluasi Model.....	39
BAB III METODE PENELITIAN.....		40
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	40
3.2	Variabel Penelitian.....	40
3.3	Tahapan Analisis Data.....	40
3.4	Diagram Alir Analisis Data.....	42
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		44
4.1	Analisis Deskripsi Data.....	44
4.2	Identifikasi Model ARFIMA.....	45
4.2.1	Stasioneritas dalam Varian.....	46
4.2.2	Stasioneritas dalam <i>Mean</i>	46
4.2.3	Identifikasi Pola <i>Long Memory</i>	47
4.2.4	Estimasi Parameter Pembeda (<i>d</i>).....	48
4.2.5	Model Awal ARFIMA.....	49

4.3	Estimasi dan Uji Signifikansi Parameter Model ARFIMA	50
4.4	Uji Asumsi Residual Model ARFIMA	52
4.4.1	Uji Normalitas Residual Model ARFIMA.....	52
4.4.2	Uji Independensi Residual Model ARFIMA	53
4.5	Model ARFIMA Terbaik	54
4.6	Uji Homoskedastisitas Residual Model ARFIMA	55
4.7	Identifikasi Model GARCH.....	56
4.7.1	Uji Independensi Residual Model GARCH.....	57
4.7.2	Uji Homoskedastisitas Residual Model GARCH.....	58
4.8	Peramalan.....	59
BAB V PENUTUP		62
5.1	Kesimpulan	62
DAFTAR PUSTAKA.....		63
LAMPIRAN		66