

ABSTRAK

Ekspor komoditas non migas memiliki peran penting dalam perekonomian Indonesia, khususnya dalam menghasilkan devisa dan menciptakan lapangan kerja. Namun, harga komoditas non migas cenderung fluktuatif akibat dinamika pasar global, perubahan permintaan-penawaran, serta faktor geopolitik. Fluktuasi harga ini menimbulkan tantangan bagi pelaku usaha dan pembuat kebijakan. Penelitian ini bertujuan untuk memodelkan dan meramalkan harga komoditas ekspor non migas di Indonesia dengan pendekatan ARIMA-EGARCH. Data yang digunakan adalah sampel data bulanan harga komoditas non migas dari Januari 2017 hingga Desember 2024 yang diperoleh dari BPS. Model ARIMA digunakan untuk menangkap pola jangka pendek, sedangkan model EGARCH digunakan untuk menangani volatilitas asimetris. Estimasi parameter pada model ARIMA menggunakan metode *maximum likelihood*. Hasil analisis menunjukkan bahwa model terbaik adalah ARIMA(2,1,2) – EGARCH(1,1), dengan nilai MAPE sebesar 6,4498%. Nilai ini menunjukkan bahwa model memiliki akurasi sangat baik dalam melakukan peramalan ($\text{MAPE} < 10\%$). Temuan ini diharapkan dapat memberikan informasi yang berguna bagi pemangku kepentingan dalam pengambilan keputusan strategis terkait ekspor komoditas non migas.

Kata Kunci: Ekspor, Peramalan, ARIMA, EGARCH