

DAFTAR ISI

HALAMAN PENGESAHAN I	iii
HALAMAN PENGESAHAN II	iv
KATA PENGANTAR	v
ABSTRAK	vi
ABSTRACT	vii
DAFTAR ISI	viii
DAFTAR TABEL	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Batasan Masalah	4
1.4 Tujuan Penelitian	4
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	6
2.1 Nilai Ekspor Non Migas	6
2.2 Analisis Deret Waktu	7
2.3 Pengujian Stasioneritas	7
2.4 <i>Autocorrelation Function</i> (ACF)	10
2.5 <i>Partial Autocorrelation Function</i> (PACF)	11
2.6 Model Deret Waktu Box-Jenkins	13
2.6.1 Model <i>Autoregressive</i> (AR)	13
2.6.2 Model <i>Moving Average</i> (MA)	14

2.6.3 Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA).....	15
2.6.4 Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA).....	15
2.7 Prosedur Pemodelan.....	16
2.7.1 Identifikasi Model.....	16
2.7.2 Estimasi Parameter	17
2.7.3 Uji Asumsi Model (<i>Diagnostic Checking</i>)	20
2.8 Pemilihan Model Terbaik	24
2.9 Model <i>Generalized Autogressive Conditional Heteroskedasticity</i> (GARCH).....	24
2.9.1 GARCH Simetris	25
2.9.2 Uji Efek Asimetris	28
2.9.3 GARCH Asimetris	30
2.10 Peramalan.....	32
BAB III METODE PENELITIAN	34
3.1 Jenis dan Sumber Data.....	34
3.2 Variabel Penelitian.....	34
3.3 Tahapan Analisis Data	34
3.4 Diagram Alir Analisis Data	37
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN	39
4.1 Statistika Deskriptif	39
4.2 Stasioneritas	40
4.2.1 Stasioneritas Dalam Varian	40
4.2.2 Stasioneritas Dalam Rata-Rata	42
4.3 Identifikasi Model ARIMA.....	44
4.4 Estimasi Parameter Model ARIMA.....	45

4.5	<i>Diagnostic Checking</i> Model ARIMA	47
4.5.1.	Uji Normalitas Residual.....	48
4.5.2.	Uji Independensi Residual	49
4.5.3.	Uji Heteroskedastisitas Residual	50
4.6	Pemilihan Model ARIMA Terbaik	51
4.7	Pemodelan ARIMA-GARCH	51
4.8	Uji Efek Asimetris	52
4.9	Pemodelan ARIMA-GARCH Asimetris.....	53
4.10	<i>Diagnostic Checking</i> Model ARIMA-EGARCH	53
4.11	Peramalan.....	54
BAB V	PENUTUP.....	57
5.1	Kesimpulan	57
5.2	Saran	57
DAFTAR	PUSTAKA	59
LAMPIRAN	62