

DAFTAR ISI

	Halaman
HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN I	ii
HALAMAN PENGESAHAN II	iii
KATA PENGANTAR.....	iv
ABSTRAK	v
ABSTRACT	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL.....	xi
DAFTAR GAMBAR	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xiii
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 Goreng Curah	8
2.2 Analisis Runtun Waktu	9
2.3 Peramalan	10

2.4	Jenis Pola Data.....	11
2.5	Stasioneritas Data	13
2.5.1	Stasioneritas dalam Varian.....	14
2.5.2	Stasioneritas dalam <i>Mean</i>	15
2.6	Autokorelasi dan Autokorelasi Parsial.....	17
2.6.1	Fungsi Autokorelasi (ACF).....	17
2.6.2	Fungsi Autokorelasi Parsial (PACF).....	18
2.7	Model Runtun Waktu Stasioner.....	20
2.7.1	Model <i>Autoregressive</i> (AR).....	21
2.7.2	Model <i>Moving Average</i> (MA).....	22
2.7.3	Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA)	23
2.8	Model Runtun Waktu Non-Stasioner.....	24
2.8.1	Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA)	24
2.8.2	Model <i>Autoregressive Fractionally Integrated Moving Average</i> (ARFIMA)	25
2.9	Tahapan Pemodelan ARFIMA.....	27
2.9.1	Identifikasi Pola <i>Long Memory</i>	27
2.9.2	Estimasi Parameter Pembeda.....	29
2.9.3	Estimasi Parameter Model ARFIMA.....	31
2.9.4	Pengujian Parameter Model ARFIMA	36
2.10	Pengujian Asumsi	37
2.10.1	Asumsi Normalitas	37
2.10.2	Asumsi <i>White Noise</i>	38
2.10.3	Asumsi Non Heteroskedastisitas	39

2.11	Model <i>Autoregressive Conditional Heteroscedasticity</i> dan <i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity</i> (ARCH dan GARCH)	41
2.12	Model ARFIMA-GARCH	42
2.12.1	Estimasi Parameter Model GARCH	43
2.12.2	Model Terbaik	46
2.12.3	Evaluasi Model	47
BAB III METODOLOGI PENELITIAN		48
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	48
3.2	Variabel Penelitian	48
3.3	Metode Analisis Data.....	48
3.4	Diagram Alir Penelitian	51
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN.....		55
4.1	Deskripsi Data	55
4.2	Stasioneritas Data	56
4.2.1	Stasioneritas dalam Varian.....	56
4.2.2	Stasioneritas dalam Mean	57
4.3	Identifikasi Pola <i>Long Memory</i>	59
4.4	Estimasi Parameter Pembeda.....	60
4.5	Identifikasi Model ARFIMA	62
4.6	Estimasi Parameter Model ARFIMA	63
4.8	Pengujian Asumsi	66
4.8.1	Asumsi Normalitas	66
4.8.2	Asumsi <i>White Noise</i>	68
4.8.3	Asumsi Non Heteroskedastisitas	69

4.10 Identifikasi dan Estimasi Model ARFIMA-GARCH	71
4.11 Asumsi Non Heteroskedastisitas Model ARFIMA-GARCH	74
4.12 Evaluasi Model	76
4.14 Pemilihan Model ARFIMA-GARCH Terbaik	78
4.15 Prediksi.....	79
BAB V KESIMPULAN.....	81
DAFTAR PUSTAKA	82
LAMPIRAN.....	88