

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
LAMPIRAN.....	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	4
1.3 Batasan Masalah	4
1.4 Tujuan Penelitian	5
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	6
2.1 Bawang Merah	6
2.2 Analisis Runtun Waktu	7
2.2.1 Stasioneritas Varian	8
2.2.2 Stasioneritas <i>Mean</i>	9
2.2.3 <i>Autocorrelation Function</i> (ACF)	11
2.2.4 <i>Partial Autocorrelation Function</i> (PACF).....	12
2.3 Model ARIMA.....	12
2.3.1 Model Autoregressive (AR).....	13
2.3.2 Model <i>Moving Average</i> (MA).....	14
2.3.3 Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA).....	14
2.3.4 Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA)	15
2.4 Identifikasi Model ARIMA.....	15
2.5 Estimasi dan Uji Signifikansi Parameter	16
2.6 Verifikasi Model	19
2.7 Uji Independensi Residual	20

2.8	Uji Normalitas Residual.....	20
2.9	Uji Homoskedastisitas Residual	21
2.10	Model ARCH/GARCH.....	22
2.10.1	Model ARCH	23
2.10.2	Model GARCH	23
2.10.3	Uji Signifikansi Parameter Model ARCH/GARCH	24
2.11	<i>Maximum Likelihood Estimation</i> (MLE)	25
2.12	Pemilihan Model Terbaik	27
BAB III METODE PENELITIAN.....		28
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	28
3.2	Variabel Penelitian.....	28
3.3	Tahapan Analisis Data	28
3.4	Diagram Alir Analisis Data	30
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		32
4.1	Deskripsi Data.....	32
4.2	Uji Stasioneritas Data	33
4.2.1	Uji Stasioneritas Varian	33
4.2.2	Uji Stasioneritas <i>Mean</i>	35
4.3	Identifikasi Model ARIMA.....	36
4.4	Estimasi Parameter.....	39
4.5	Uji Signifikansi Parameter	39
4.6	Uji Normalitas Residual.....	50
4.7	Uji Independensi Residual	52
4.8	Uji Homoskedastisitas Residual	53
4.9	Ringkasan Hasil Pengujian ARIMA.....	54
4.10	Pemodelan ARCH-GARCH	57
4.10.1	Identifikasi Model ARCH dan GARCH	57
4.10.2	Estimasi Parameter ARCH dan GARCH.....	59
4.10.3	Model Terbaik.....	60
4.10.4	Uji ARCH-LM	61
4.11	Persamaan Model Terbaik	62

BAB V PENUTUP.....	64
5.1 Kesimpulan	64
5.2 Saran	64
DAFTAR PUSTAKA	66
LAMPIRAN.....	69