

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.....	6
1.3 Batasan Masalah	6
1.4 Tujuan Penelitian	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	7
2.1 Cabai merah keriting.....	7
2.2 Analisis Runtun Waktu	8
2.2.1 Stasioneritas Data	9
2.2.2 Fungsi Autokorelasi	12
2.2.3 Fungsi Autokorelasi Parsial.....	13
2.3 Model <i>Time Series Autorgressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA)	13
2.3.1 Model <i>Autoregressive</i> (AR)	14
2.3.2 Model <i>Moving Average</i> (MA).....	15
2.3.3 Model <i>Autoregressive Moving Average</i> (ARMA)	15
2.3.4 Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average</i> (ARIMA)	16
2.4 Identifikasi Model.....	17
2.5 Estimasi Parameter	17

2.6	Uji Signifikansi Parameter.....	19
2.6.1	Uji Signifikansi Parameter $AR(p)$	20
2.6.2	Uji Signifikansi Parameter $MA(q)$	20
2.7	Verifikasi Model	20
2.7.1	Uji Independensi Residual.....	21
2.7.2	Uji Normalitas Residual	22
2.7.3	Uji Heteroskedastisitas Residual ($ARCH - LM$)	23
2.8	Metode $ARCH / GARCH$	24
2.8.1	Model $ARCH$	24
2.8.2	Model $GARCH$	25
2.9	Estimasi Parameter dan Uji Signifikansi Parameter Model $ARCH-GARCH$	25
2.9.1	Uji Signifikansi Parameter Model $ARCH$	27
2.9.2	Uji Signifikansi Parameter Model $GARCH$	27
2.10	Pemilihan Model Terbaik	28
BAB III METODE PENELITIAN.....		29
3.1	Jenis dan Sumber Data.....	29
3.2	Variabel Penelitian.....	29
3.3	Tahapan Analisis Data	29
3.4	Diagram Alir Analisis Data	30
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		33
4.1	Karakteristik Data	33
4.2	Uji Stasioneritas Data	35
4.2.1	Uji Stasioneritas dalam Varian.....	35
4.2.2	Uji Stasioneritas dalam <i>Mean</i>	37
4.3	Identifikasi Model.....	39
4.4	Estimasi Parameter dan Uji Signifikansi Parameter	42
4.5	Uji Independensi Residual	43
4.6	Uji Normalitas Residual.....	44
4.7	Uji Heteroskedastisitas Residual ($ARCH - LM$).....	45
4.8	Pemilihan Model Terbaik	46
4.9	Pemodelan $ARCH-GARCH$	48

4.10	Identifikasi Model ARCH-GARCH	49
4.11	Estimasi Parameter dan Uji Signifikansi Model ARCH-GARCH ..	51
4.12	Uji Independensi Residual Model ARCH-GARCH	52
4.13	Uji ARCH-LM MODEL ARCH-GARCH	54
4.14	Model Terbaik.....	54
4.15	Persamaan Model Terbaik	56
BAB V KESIMPULAN.....		57
5.1	Kesimpulan	57
5.2	Saran	57
DAFTAR PUSTAKA		59
LAMPIRAN.....		62