

DAFTAR ISI

LEMBAR JUDUL.....	ii
LEMBAR PERNYATAAN	iii
LEMBAR PENGESAHAN	iv
LEMBAR PEDOMAN PENGGUNAAN SKRIPSI.....	v
SURAT PERNYATAAN ORISINILITAS	vi
KATA PENGANTAR.....	vii
ABSTRAK.....	viii
ABSTRACT.....	ix
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR.....	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Tujuan Penelitian	4
1.4 Manfaat Penelitian	4
1.5 Batasan Masalah	4
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	5
2.1 Cabai Rawit Kota Surabaya.....	5
2.2 Volatilitas.....	7
2.3 Heteroskedastisitas	8
2.4 <i>Time Series</i>	8
2.5 Stasioneritas Data <i>Time Series</i>	12

2.6	Spesifikasi Model ARIMA.....	14
2.7	Model-Model <i>Time Series</i>	17
2.8	Estimasi Parameter Model.....	21
2.9	Konsep Parsimony	22
2.10	Model ARCH (Autoregressive Conditional Heteroscedasticity)	25
2.11	Model GARCH (Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity)	26
2.12	Model EGARCH (Exponential Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity).....	27
2.13	Prediksi Model GARCH.....	29
2.14	Prediksi Model EGARCH	30
2.15	Identifikasi Adanya Proses ARCH-GARCH dan EGARCH.....	31
2.16	Estimasi Parameter Model ARCH-GARCH dan Model EGARCH.....	33
2.17	Pengujian Parameter Model ARCH-GARCH dan Model EGARCH.....	35
2.18	Kriteria Model Terbaik.....	35
2.19	Peramalan	36
2.20	Minitab	37
2.21	EViews	39
BAB III METODE PENELITIAN		41
3.1	Data dan Sumber Data.....	41
3.2	Variabel Penelitian.....	42
3.3	Langkah Analisis.....	42
3.3.1	Memodelkan harga cabai rawit dengan pendekatan Model GARCH dan Model EGARCH.....	42
3.3.2	Prediksi dan Validasi Model GARCH dan Model EGARCH.....	42
3.4	Diagram Alur (<i>Flow Chart</i>)	45
BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN		47

4.1	Estimasi Model Volatilitas	47
4.1.1	Eksplorasi Data	47
4.1.2	Uji Stasioneritas Data.....	48
4.1.3	Transformasi Box-Cox dan <i>Differencing</i> Data.....	49
4.1.4	Pengidentifikasian Model ARIMA	52
4.1.5	Uji <i>Diagnostic</i> Residual Model ARIMA(1,2,0) ..	54
4.1.6	Identifikasi Model Gabungan ARIMA-GARCH Dugaan.....	55
4.1.7	Estimasi Parameter dan Uji Signifikasi Parameter Model ARIMA-GARCH	55
4.1.8	Uji <i>Diagnostic</i> Residual Model Gabungan ARIMA(1,2,0)-GARCH(0,2)	57
4.1.9	Uji Pengaruh Asimetrik	58
4.1.10	Identifikasi Model Gabungan ARIMA(1,2,0)- EGARCH.....	59
4.1.11	Estimasi Parameter dan Uji Signifikansi Parameter Model ARIMA-EGARCH	59
4.1.12	Uji <i>Diagnostic</i> Residual Model Gabungan ARIMA(1,2,0)-EGARCH(1,2)	61
4.1.13	Kriteria Model Gabungan Terbaik	62
4.2	Prediksi dan Validasi	62
4.2.1	Prediksi dan Validasi Model GARCH(0,2)	62
4.2.2	Prediksi dan Validasi Model EGARCH(1,2)	64
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN		67
5.1	Kesimpulan	67
5.2	Saran.....	67
DAFTAR PUSTAKA		68

DAFTAR TABEL

Nomor	Judul Tabel	Halaman
2.1	Nilai λ dan Transformasinya.....	14
3.1	Data Harga Cabai Rawit (per Kg) Periode Mingguan Januari minggu ke-1 2019 – Maret minggu ke-1 2021.....	41
4.1	Uji Stasioneritas <i>Augmented Dickey-Fuller</i>	48
4.2	Hasil Analisis Model ARIMA.....	52
4.3	Normalitas Residual Model ARIMA.....	53
4.4	Hasil Uji Autokorelasi Model ARIMA(1,2,0).....	54
4.5	Uji Ljung-Box Residual Kuadrat.....	55
4.6	Hasil Analisis Model Gabungan ARIMA(1,2,0)- GARCH(p,q).....	56
4.7	Kriteria Model Gabungan ARIMA(1,2,0)-GARCH Terbaik.....	56
4.8	Uji <i>Diagnostic</i> Residual Model Gabungan ARIMA(1,2,0)-GARCH(0,2).....	57
4.9	Hasil Analisis Model Gabungan ARIMA(1,2,0)- EGARCH(p,q).....	59
4.10	Uji <i>Diagnostic</i> Residual Model Gabungan ARIMA(1,2,0)-EGARCH(1,2).....	61
4.11	Kriteria Model Gabungan Terbaik.....	62
4.12	Prediksi Model Gabungan ARIMA(1,2,0)- GARCH(0,2).....	62
4.13	Prediksi Model Gabungan ARIMA(1,2,0)- EGARCH(1,2).....	64

DAFTAR GAMBAR

Nomor	Judul Gambar	Halaman
2.1	<i>Time Series</i> Pola Horizontal (H)	10
2.2	<i>Time Series</i> Pola Musiman (S)	10
2.3	<i>Time Series</i> Pola Siklis (C)	11
2.4	<i>Time Series</i> Pola Trend (T)	11
3.1	<i>Flow Chart</i> Langkah-langkah Analisis Data.....	45
4.1	Plot <i>Time Series</i> Harga Cabai Rawit Kota Surabaya....	48
4.2	Diagram Transformasi <i>Box-Cox</i> Harga Cabai Rawit Kota Surabaya.....	49
4.3	Plot Data <i>Differencing Lag 1</i>	50
4.4	Plot ACF dan PACF Data <i>Differencing Lag 1</i>	50
4.5	Plot Data <i>Differencing Lag 2</i>	51
4.6	Plot ACF dan PACF Data <i>Differencing Lag 2</i>	51
4.7	Plot ACF dan PACF Residual Kuadrat Model ARIMA(1,2,0).....	54
4.8	<i>Cross Correlation</i> Uji Asimetris.....	58
4.9	Plot <i>Time Series</i> Aktual, Prediksi ARIMA(1,2,0),Prediksi Batas Atas dan Batas Bawah Model GARCH(0,2)	64
4.10	Plot <i>Time Series</i> Aktual, Prediksi ARIMA(1,2,0),Prediksi Batas Atas dan Batas Bawah Model EGARCH(1,2)	65

DAFTAR LAMPIRAN

Nomor	Judul
1a	<i>In Sample</i> Data Harga Cabai Rawit Kota Surabaya Periode minggu ke-1 Januari 2019 Sampai minggu ke-4 Januari 2021
1b	<i>In Sample</i> Data Harga Cabai Rawit Kota Surabaya Periode minggu ke-1 Februari 2021 Sampai minggu ke-1 Maret 2021
2a	<i>Output</i> Uji Stasioneritas <i>Software</i> EViews dan Minitab
2b	<i>Output</i> ARIMA dan Uji Normalitas Residual <i>Software</i> Minitab
2c	<i>Output</i> Uji <i>Diagnostic</i> Residual Model ARIMA(1,2,0) <i>Software</i> EViews
2d	<i>Output</i> Model GARCH(p,q) <i>Software</i> EViews
2e	<i>Output</i> Model EGARCH(p,q) <i>Software</i> EViews
2f	<i>Output</i> Prediksi