

DAFTAR ISI

	Halaman
LEMBAR JUDUL	i
LEMBAR PERNYATAAN	ii
LEMBAR PENGESAHAN NASKAH PROPOSAL	iii
PEDOMAN PENGGUNAAN SKRIPSI	iv
SURAT PERNYATAAN TENTANG ORISINALITAS	v
KATA PENGANTAR	vi
ABSTRAK	vii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR LAMPIRAN	xiv
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	5
1.3 Tujuan Penelitian	5
1.4 Manfaat Penelitian	6
1.5 Batasan Masalah	6
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Lemak dan Minyak Nabati atau Hewani	7
2.2 Ekspor	7
2.3 Volatilitas	9
2.4 <i>Time Series</i>	9
2.5 Stasioeritas Data <i>Time Series</i>	11
2.5.1 Stasioner dalam <i>Varians</i>	11
2.5.2 Stasioner dalam Mean	11
2.6 <i>Autocorrelation Function (ACF)</i>	13

2.7	<i>Partial Autocorrelation Function (PACF)</i>	14
2.8	Identifikasi Model <i>Time Series</i>	15
2.8.1	Model <i>Autoregressive (AR)</i>	15
2.8.2	Model <i>Moving Average (MA)</i>	16
2.8.3	Model <i>Autoregressive Moving Average (ARMA)</i>	17
2.8.4	Model <i>Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA)</i>	18
2.9	Estimasi Parameter Model	19
2.10	Konsep Parsimony	20
2.11	Model <i>Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (ARCH)</i>	22
2.12	Model <i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (GARCH)</i>	23
2.13	Model <i>Exponential Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (EGARCH)</i>	24
2.14	Identifikasi Adanya Proses ARCG-GARCH dan EGARCH.....	25
2.15	Estimasi Parameter Model ARCH-GARCH dan EGARCH	26
2.16	Pengujian Parameter ARCH-GARCH dan EGARCH.....	28
2.17	Kriteria Model Terbaik	28
2.18	<i>Forecasting</i>	29
2.19	<i>Software Minitab</i>	30

BAB III METODOLOGI PENELITIAN

3.1	Data dan Sumber Data	32
3.2	Variabel Penelitian.....	32
3.3	Langkah Analisis Data	32
3.4	Diagram Alur (Flow Chart)	36

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN

4.1	Pemodelan Nilai Ekspor dengan Model GARCH dan EGARCH	37
4.1.1	Identifikasi Kestasioneran Data	37
4.1.2	Identifikasi Model ARIMA	41
4.1.3	Uji Diagnostic Residual Model ARIMA	42
4.1.4	Pemilihan Model Terbaik ARIMA	45

4.1.5	Pendugaan Kasus Heteroskedastisitas	45
4.1.6	Identifikasi Model GARCH.....	47
4.1.7	Estimasi Parameter dan Uji Signifikan Parameter Model GARCH	47
4.1.8	Uji Diagnostic Residual Model GARCH(1,1).....	49
4.1.9	Uji Pengaruh Asimetris.....	50
4.1.10	Identifikasi Model EGARCH Dugaan.....	50
4.1.11	Estimasi Parameter dan Uji Signifikan Parameter Model EGARCH	50
4.1.12	Uji Diagnostic Residual Model EGARCH(1,1)	52
4.1.13	Kriteria Model Terbaik	53
4.2	Peramalan dan Validasi pada Model GARCH dan EGARCH	53

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN

5.1	Kesimpulan	56
5.2	Saran	56

DAFTAR TABEL

Nomor	Judul Tabel	Halaman
2.1	Transformasi <i>Tukey</i>	12
2.2	Struktur ACF dan PACF	15
4.1	Hasil Estimasi Parameter Model	41
4.2	Hasil Ljung-Box Test Residual	43
4.3	Hasil Uji Kolmogorov-Smirnov	44
4.4	Ringkasan Hasil <i>Diagnostic Check</i>	44
4.5	Hasil MSE	45
4.6	Uji ARCH Residual Kuadrat	47
4.7	Hasil Analisis Model GARCH	48
4.8	Uji <i>Diagnostic</i> Residual Model GARCH(1,1)	49
4.9	Hasil Analisis Model EGARCH(p,q)	51
4.10	Uji <i>Diagnostic</i> Residual Model EGARCH(1,1)	52
4.11	Kriteria Model Terbaik	53

DAFTAR GAMBAR

Nomor	Judul Tabel	Halaman
3.1	Diagram Alur Penelitian	36
4.1	Plot <i>Time Series</i> Nilai Ekspor Lemak dan Minyak Nabati atau Hewani di Indonesia	38
4.2	Diagram Transformasi Box-Cox Nilai Ekspor Lemak dan Minyak Nabati atau Hewani di Indonesia	39
4.3	Plot Data <i>Differencing</i>	39
4.4	Plot ACF Data <i>Differencing</i> Nilai Ekspor Lemak dan Minyak Nabati atau Hewani di Indonesia	40
4.5	Plot PACF Data <i>Differencing</i> Nilai Ekspor Lemak dan Minyak Nabati atau Hewani di Indonesia	40
4.6	Plot ACF Residual Kuadrat Model ARIMA (2,1,0)	46
4.7	Plot PACF Residual Kuadrat Model ARIMA(2,1,0)	46
4.8	Cross Correlation Uji Efek Asimetris	50
4.9	Plot <i>Time Series</i> Data Aktual, Forecast GARCH, Batas Atas, dan Batas Bawah	54
4.10	Plot <i>Time Series</i> Data Aktual, Forecast GARCH, Batas Atas, dan Batas Bawah	54

DAFTAR LAMPIRAN

Nomor	Judul
1	<i>Data In Sample</i> Nilai Ekspor Lemak dan Minyak Nabati atau Hewani di Indonesia (US \$ <i>Thousand</i>) Periode Agustus 2007-Februari 2018
2	<i>Data Out Sample</i> Nilai Ekspor Lemak dan Minyak Nabati atau Hewani di Indonesia (US \$ <i>Thousand</i>) Periode Agustus 2007-Februari 2018
3a	<i>Output</i> ARIMA dan Uji Normalitas Residual <i>Software Eviews</i>
3b	<i>Output</i> Uji ARCH Residual Kuadrat <i>Software Eviews</i>
3c	<i>Output</i> Model GARCH(p,q) <i>Software Eviews</i>
3d	<i>Output</i> Uji <i>Diagnostic</i> Residual Model GARCH(1,1)
3e	<i>Output</i> Model EGARCH(p,q) <i>Software Eviews</i>
3f	<i>Output</i> Uji <i>Diagnostic</i> Residual Model EGARCH(1,1)
3g	<i>Output Forecasting Software Eviews</i>