

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	iii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI.....	iv
NASKAH SOAL TUGAS AKHIR.....	vi
KATA PENGANTAR	vii
UCAPAN TERIMA KASIH.....	viii
DAFTAR ISI.....	x
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN.....	xv
INTISARI.....	xvi
ABSTRACT.....	xvii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1. Latar Belakang	1
1.2. Rumusan Masalah	3
1.3. Asumsi dan Batasan	4
1.4. Tujuan Penelitian	5
1.5. Manfaat Penelitian	5
BAB II TINJAUAN PUSTAKA.....	6
BAB III LANDASAN TEORI.....	17
3.1. Minyak Kelapa Sawit.....	17
3.2. Risiko	18
3.2.1. Jenis-jenis risiko.....	20
3.2.2. Manajemen Risiko	20
3.2.3. Standar Manajemen Risiko	22
3.2.4. Prinsip Manajemen Risiko berdasarkan ISO 31000: 2018 ...	24
3.2.5. Proses Manajemen Risiko	25
3.2.5.1. Identifikasi Risiko	27
3.2.5.2. Analisis Risiko	27

3.2.5.2.1. Value At Risk	28
3.2.5.4. Evaluasi Risiko.....	30
3.3. Simulasi Monte Carlo	31
3.4. Indikator Akaike Information Criterion (AIC)	33
3.5 Identifikasi dan Karakteristik Data	34
3.5.1 <i>Moving Average</i>	35
3.6 Return	35
3.7 Volatilitas	36
3.8 Proses Stokastik.....	36
3.9 <i>Lemma Itô</i>	37
3.10 Gerak Brown	37
3.10.1 Gerak Brown	37
3.10.2 Gerak Brown Standar	38
3.10.3 Gerak Brown dengan Suku <i>Drift</i>	38
3.10.4 Gerak Brown Geometrik	39
3.11 Model Pergerakan Harga dengan GBM.....	39
3.12 @RISK Palisade <i>Software</i>	42
3.13 Metrik Evaluasi Kinerja Metode Prediksi.....	43
BAB IV METODE PENELITIAN	45
4.1. Objek Penelitian	45
4.2. Alat Penelitian.....	45
4.3. Alur Penelitian	45
4.3.1. Identifikasi dan perumusan masalah	47
4.3.2. Studi Literatur	47
4.3.3. Pengambilan data	47
4.3.4. Persiapan Data.....	48
4.3.4.1. Persiapan Data untuk GBM.....	48
4.3.4.2. Persiapan Data untuk <i>Moving Average</i>	51
4.3.5. Pemodelan Prediksi Harga	52
4.3.6. Verifikasi Model	52

4.3.7. Prediksi Harga dan Perbandingan	53
4.3.8. Perhitungan <i>Value at Risk</i>	55
4.3.9. Evaluasi Kemampuan Model Prediksi	56
4.3.10. Hasil dan pembahasan	56
4.3.11. Kesimpulan dan saran	56
BAB V HASIL DAN PEMBAHASAN.....	57
5.1. Penentuan Data.....	57
5.2. Hasil Persiapan Data untuk GBM	58
5.3. Hasil Persiapan Data untuk Moving Average	61
5.4. Pemodelan Prediksi Harga	62
5.5. Verifikasi Model	62
5.6. Prediksi Harga dan Perbandingan	64
5.7. Perhitungan <i>Value at Risk</i>	68
5.8. Pengukuran Kemampuan Prediksi	70
5.9. Analisis Hasil Pengukuran Kemampuan Prediksi Model	71
5.10. Pembahasan hasil	72
BAB VI PENUTUP	73
6.1. Kesimpulan	73
6.2. Saran.....	74
DAFTAR PUSTAKA	75
LAMPIRAN	82