

**Deja Abd. Rahim, 04371911010, Analisis Volatilitas Harga Komoditi Pala
(*Myristica Fragrans Houtt*) Di Kota Ternate.**

Pembimbing : Mardiyani Sidayat, S.P.,MA

: Dr. Natal Basuki, S.Pt.,M.Si

RINGKASAN

Volatilitas harga adalah besarnya jarak antara fluktuasi/naik turunnya harga. Volatilitas merupakan metode statistik untuk mengukur fluktuasi harga selama periode tertentu, namun bukan untuk mengukur tingkat harga melainkan mengukur tingkat variasinya. volatilitas tinggi berarti harga naik tinggi dengan cepat lalu tiba-tiba turun dengan cepat pula, sehingga memunculkan selisih sangat besar antara harga terendah dan harga tertinggi dalam suatu waktu. Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis volatilitas harga pala di kota Ternate dengan menggunakan metode analisis ARCH (*Autoregressive Conditional Heteroscedasticity*), GARCH (*Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity*) dan ARIMA (metode peramalan). Adapula tujuan lainnya yaitu untuk mengetahui faktor-faktor yang mempengaruhi volatilitas harga pala di kota Ternate dengan menggunakan metode Analisis Regresi Linear Berganda. Data yang dikumpulkan diolah menggunakan excel dan dianalisis menggunakan *Softwer E-Views 10* dengan uji stanisoner dan *colleogram*. Hasil penelitian menggunakan analisis ARCH/GARCH menunjukan bahwa harga pala dikota Ternate mengalami volatilitas tinggi, Sedangkan berdasarkan analisis Regresi Linear Berganda variabel signifikan pada setiap pengujian dengan ketentuan taraf kepercayaan hingga karakteristik pengujian yang telah ditetapkan dan digunakan oleh peneliti-peneliti sebelumnya.

Kata kunci : Volatilitas, Harga, Inflasi, Tanaman Pala. ARCH/GARCH, ARIMA, Regresi Linear Berganda.

Deja Abd. Rahim, 04371911010, Analysis of Price Volatility of Nutmeg (*Myristica Fragrans Houtt*) Commodity in Ternate City.

Supervisor : Mardiyani Sidayat, S.P.,MA

: Dr. Natal Basuki, S.Pt.,M.Si

SUMMARY

Price volatility is the amount of distance between price fluctuations/fluctuations. Volatility is a statistical method to measure price fluctuations over a certain period, but not to measure price levels but to measure the level of variation. High volatility means that the price rises high quickly and then suddenly drops quickly, resulting in a huge difference between the lowest price and the highest price at a time. This study aims to analyze the volatility of nutmeg prices in the city of Ternate by using the ARCH analysis method (*Autoregressive Conditional Heteroscedasticity*), GARCH (*Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity*) and ARIMA (forecasting method). There is also another goal, namely to find out the factors that affect the volatility of nutmeg prices in the city of Ternate by using the Multiple Linear Regression Analysis method. The data collected was processed using excel and analyzed using *Softwer E-Views 10* with stanisonar test and *colleogram*. The results of the study using ARCH/GARCH analysis show that the price of nutmeg in the city of Ternate experiences high volatility, while based on the Multiple Linear Regression analysis, significant variables in each test with the provision of a level of confidence to the characteristics of the test that have been determined and used by previous researchers.

Keywords: Volatility, Prices, Inflation, Nutmeg Crops. ARCH/GARCH, ARIMA, Multiple Linear Regression.