



## Intisari

Cabai merah besar merupakan komoditas hortikultura dengan nilai ekonomi yang tinggi. Cabai merah besar yang memiliki tingkat permintaan yang konstan cenderung kontinu dan penawaran yang bersifat musiman membuat harga cabai merah besar mengalami perubahan dalam waktu yang singkat. Penelitian ini bertujuan untuk (1) memprakirakan harga cabai merah besar di Indonesia pada periode September 2019-Desember 2020 (2) mengetahui perilaku harga cabai merah besar di Indonesia pada periode Desember 2013-Agustus 2019 (3) mengetahui nilai volatilitas harga cabai merah besar di Indonesia pada periode Desember 2013-Agustus 2019. Data yang dianalisis adalah data bulanan harga cabai merah di Indonesia periode Desember 2013-Agustus 2019. Prakiraan harga cabai merah besar dilakukan dengan menggunakan model ARIMA (*Autoregressive Integrated Moving Average*). Nilai volatilitas dan perilaku harga cabai merah besar diketahui dengan menggunakan model ARCH/GARCH (*Autoregressive Conditional Heteroscedasticity/Generate Autoregressive Conditional Heteroscedasticity*). Model ARIMA yang digunakan adalah model ARIMA (2,1) dengan hasil prakiraan harga cabai merah besar di Indonesia menurun pada periode prakiraan. Model ARCH/GARCH yang digunakan adalah model GARCH (1,0) dengan hasil volatilitas harga cabai merah besar di Indonesia bervolatil dan tergolong ke dalam *low volatility*.

Kata kunci : Cabai Merah Besar, Prakiraan, Volatilitas, Perilaku Harga, ARCH/GARCH



### ***Abstract***

*Chili pepper is a horticultural commodities with high economic values. The constant demand rate with seasonal supply make chilli pepper price change in a short time. This study aims to (1) estimate the Indonesia chili pepper price in September 2019 to December 2020 (2) knowing the Indonesia chilli pepper price behavior in December 2013 to August 2019 (3) knowing the Indonesia chilli pepper price volatility value in December 2013 to August 2019. The data used in this research is chilli pepper monthly prices in Indonesia from December 2013 to August 2019. The analysis showed that the exact ARIMA used in this research is ARIMA (2,1) which then show that chilli pepper price will decline. The analysis also showed that the exact ARCH/GARCH models used in this research is GARCH (1,0) which then show that chilli pepper price in this research is volatile and classified in low volatility.*

*Key words : Chilli Pepper, Forecasting, Volatility, Price Behaviour, ARCH/GARCH*