ABSTRAK

Kustiara, Sri, 2019, *Penerapan Metode ARCH GARCH Dalam Meramalkan Indeks Harga Konsumen (IHK) di Kota Semarang*, Skripsi, Program Studi Statistika, Universitas Muhammadiyah Semarang, Pembimbing: I. Indah Manfaati Nur, S.Si, M.Si, , II. Tiani Wahyu Utami, S.Si, M.Si

Kata Kunci :Peramalan, ARCH GARCH, Indeks Harga Konsumen

Indeks Harga Konsumen (IHK) merupakan salah satu indikator ekonomi penting yang dapat memberikan informasi mengenai perkembangan harga barang/jasa yang dibayar oleh konsumen di suatu wilayah. Penghitungan IHK ditujukan untuk mengetahui perubahan harga dari sekelompok tetap barang atau jasa yang umumnya dikonsumsi oleh masyarakat setempat. Dalam metode yang digunakan dalam pemodelan data runtun waktu memiliki syarat khusus yaitu yang teridentifikasi efek heteroskedastisitas. Tujuan dari penelitian ini adalah untuk mengetahui model terbaik peramalan periode berikutnya serta hasil prediksi periode mendatang. Variabel yang digunakan adalah data Indeks Harga Konsumen dalam bulan. Sehingga untuk mengatasi permasalahan pada data penelitian ini digunakan metode *Autoregressive Conditional Heteroscedasticity Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity* (ARCH GARCH). Hasil dari penelitian ini didapatkan metode ARCH GARCH model terbaik yang digunakan adalah ARIMA (1,1,1)~GARCH (1,0). Dengan prediksi dari volatilitas dengan nilai standar deviasi 0.98283514 diperoleh prediksi volatilitas terendah sebesar 0.9632546 dan prediksi volatilitas tertinggi sebesar 0.9980155 .

http://repository.unimus.ac.id