

Siti Sulaeha. 12032110010. Volatilitas Sayuran Cabai Rawit dan Tomat di Pasar Anom Baru Kabupaten Sumenep. Dibawah bimbingan Dr. Teti Sugiarti, SP., M.Si

ABSTRAK

. Tingkat risiko yang ada pada harga kedua sayuran di Pasar Anom Baru Sumenep dapat memberikan gambaran seberapa tingkat ketidakpastian yang diterima oleh penjual dan pembeli. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui nilai volatilitas harga sayuran cabai rawit dan tomat yang ada di Pasar Anom Baru Sumenep. Selain itu akan di analisis pengaruh jumlah pasokan kedua sayuran dengan harga kedua sayuran. Data yang digunakan dalam proses analisis ini adalah data time series harga sayuran dari awal bulan Januari 2011 sampai akhir bulan desember 2015. Untuk menjawab tujuan penelitian digunakan model ARCH-GARCH dan pengujian kointegrasi dengan two step Engle-Granger antara jumlah pasokan dengan harga kedua sayuran, dilakukan dengan bantuan program komputer Eviews 6, Microsoft Excel 2007 . Hasil analisis menunjukkan bahwa dari kedua sayuran yang diuji, Cabai Rawit merupakan sayuran dengan nilai volatilitas paling tinggi dengan tingkat risiko yang tinggi, sedangkan sayuran dengan nilai volatilitas paling rendah adalah tomat dengan tingkat risiko rendah. Dari hasil pengujian regresi dan kointegrasi dengan menggunakan *two step* Engle-Granger antara jumlah pasokan kedua sayuran dengan harga kedua sayuran dapat disimpulkan bahwa jumlah pasokan memiliki hubungan jangka panjang dan berpengaruh negatif dengan harga kedua sayuran tersebut

Kata Kunci: Sayuran cabai rawit dan tomat, pergerakan harga, volatilitas.

Siti Sulaeha. 120321100010. Volatility Vegetable of Chili and Tomato in New Anom Market Sumenep Regency. Supervised by Dr. Teti Sugiarti, SP., M.Si

ABSTRACT

The level of risk in both the price of vegetables in new Anom market Sumenep can give an idea of how the level of uncertainty that was accepted by the seller and buyer. This research aims to determine the value of the price volatility between the both vegetables with a supply amount of vegetables. The files was used in this analysis is time series files of the vegetables prices from the begined of January 2011 untill the end of December 2015. To answer this research was used two steps Engle-Granger between the amount of supply with the price of two vegetables. The analysis showed that both the vegetables tested the chili has a highest volatility value with. The high risk level, while the vegetables with the lowest volatility value is tomatoes. The results of regression tested and cointegration that used two steps Engel-Granger between that second supply of vegetables at a price of two vegetables could be concluded that the amount of supplies has long-tem relationships and negatively affected by the price of these vegetables.

Keywords. Vegetable of chili and tomato, Price movements, Volatility.

KATA PENGANTAR



Segala puji syukur penulis panjatkan kehadirat Allah SWT yang maha pengasih lagi maha penyayang yang telah memberikan rahmat, taufiq dan hidayah-Nya sehingga penulis dapat menyelesaikan skripsi dengan judul “Analisis Daya Rajungan Kupas di Kabupaten Pamekasan” telah selesai di susun untuk memenuhi persyaratan menuju jenjang sarjana.

Sholawat serta salam tetap terlimpah curahkan kepada kehariba’an pahlawan islam yakni baginda rasul Muhammad Ibnu Abdillah yang telah mewariskan jalan terang untuk umatnya dengan adanya islam, iman dan ihsan.

Perjuangan penulisan skripsi ini telah penulis lalui. Motivasi dan inspirasi dalam penulisan skripsi banyak penulis dapatkan dari berbagai pihak, taka da kata yang tepat untuk disampaikan oleh penulis, kecuali ucapan terima kasih dan penghargaan sebesar-besarnya kepada:

1. Teristimewa untuk orang tuaku Bapak dan ibuku tercinta yaitu H. Imam Tahari dan Hj. Nafisatun dan Abangku Zainal Arifin, yang tiada henti memberikan dukungan, kasih sayang dan do’a kepada penulis. Menjadi kebanggaan orang tua itulah yang memicu penulis untuk mengembangkan prestasi dan penyelesaian skripsi ini, sehingga gelar sarjana bisa ananda persembahkan untuk beliau.
2. Kepada Tunanganku Ardi Jamaluddin yang selalu memberi apa yang aku butuhkan dan terima kasih selama awal pendaftaran kuliah sampai aku lulus masi tetap bersamaku. Terima kasih selalu bersamaku saat susah dan senang.
3. Dr. Ir. Slamet Subari, M.Si selaku Dekan Fakultas Pertanian Universitas Trunojoyo Madura.
4. Dr. Teti Sugiarti, SP., M.Si Selaku kepala jurusan Agribisnis fakultas pertanian Universitas Trunojoyo Madura, yang telah banyak memberikan ilmu selama menempuh studi di Universitas Trunojoyo Madura.
5. Dr. Teti Sugiarti, SP., M.Si. Selaku dosen pembimbing skripsi, Dr. Elys Fauziyah, SP., M.Siselaku dosen pembimbing seminar dan Andrie Kisroh

Sunyigono, SP., MP., Ph.D selaku dosen penguji yang dengan penuh kesabaran dan kesungguhan dalam memberikan arahan, petunjuk dan bimbingan sehingga penulis bisa menyelesaikan skripsi.

6. Segenap dosen Universitas Trunojoyo Madura yang telah membimbing penulis dalam selama menempuh studi di Universitas Trunojoyo Madura (UTM), Semoga Allah SWT selalu melimpahkan rahmat dan hidayahnya kepada beliau.
7. Teman-teman seperjuanganku Agribisnis 2012 terima kasih telah bersama ketika suka maupunduka selama kuliah, rasa syukur kepada Allah telah mempertemukan kita , setelah ini mungkin kita akan rindu suasana dalam kelas, jika kelak kita tak lagi di tempat yang sama. Ingatlah, bahwa kita pernah berjuang bersama.

Akhirnya penulis menyadariakan masih terdapat kekurangan dan kekeliruan dalam skripsi ini. Untuk itu, saran dan kritik yang membangun untuk sempurnanya tulisan ini sangat penulis harapkan. Semoga skripsi ini dapat memberikan manfaat bagi penulis khususnya dan bagi para pembaca umum. Aamiin.

Bangkalan, 17 Februari 2017

Penulis

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING	iv
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN KARYA ILMIAH	v
HALAMAN PERSEMBAHAN	vii
ABSTRAK	viii
ABSTRACT	ix
KATA PENGANTAR	x
DAFTAR ISI	xiii
DAFTAR TABEL	xv
DAFTAR GAMBAR	xvi
DAFTAR LAMPIRAN	xvii

BAB IPENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah.....	3
1.3 Tujuan Penelitian	3
1.4 Manfaat Penelitian	3
1.5 Ruang Lingkup Penelitian.....	4

BAB IITINJAUAN PUSTAKA

2.1 Landasan Teori	5
2.1.1 Teori Harga.....	5
2.1.1.1 Kebijakan Penetapan Harga	5
2.1.1.2 Teori Permintaan dan Penawaran	6
2.1.1.3 Hukum Permintaan dan Penawaran	6
2.1.1.4 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Permintaan dan Penawaran.....	7
2.1.1.5 Elastisitas Permintaan dan Penawaran.....	8
2.2 Konsep Risiko	9
2.3 Pemodelan Volatilitas Time Series Univariate	11
2.3.1 ARCH Error	13
2.3.2 Mean Proses.....	13
2.3.3 Variance Proses.....	14
2.3.4 Metode Peramalan Box-Jenkins (model ARIMA)	14
2.3.4.1 Tahapan Identifikasi.....	15
2.3.4.2 Tahapan Pendugaan Parameter	16
2.3.4.3 Tahapan Evaluasi	16
2.3.5 Model ARCH-GARCH.....	17
2.4 Penelitian Terdahulu.....	18
2.5 Kerangka Berpikir	24

BAB IIIMETODE PENELITIAN

3.1 Lokasi dan Waktu Penelitian.....	27
3.2 Jenis dan Sumber Data	27
3.3 Metode Analisis Data.....	27
3.3.1 Analisis Volatilitas Aplikasi Model ARCH-GARCH	27

3.3.1.1 Tahapan Identifikasi.....	28
3.3.1.2 Tahapan Pendugaan Parameter.....	28
3.3.1.3 Tahapan Pemilihan ARCH-GARCH Terbaik	29
3.3.1.4 Tahapan Pemeriksaan Model ARCH-GARCH ..	29
3.3.2 Kointegrasi.....	31
BAB IV GAMBARAN UMUM	
4.1 Letak Geografis	33
4.2 Kondisi Geografis	34
4.2.1 Letak Lokasi	34
4.3 Kondisi Demografi dan Kependudukan.....	34
4.3.1 Penduduk	34
4.3.2 Sektor Pertanian di Kabupaten Sumenep	36
4.3.3 Mata Pencarian Penduduk.....	36
4.4 Perkembangan Produksi Sayuran di Kabupaten Sumenep....	36
BAB V HASIL DAN PEMBAHASAN	
5.1 Deskripsi Pergerakan Harga Sayuran Cabai rawit dan Tomat	38
5.1.1 Eksplorasi Pola Data Sayuran Cabai rawit.....	38
5.1.2 Eksplorasi Pola Data Sayuran Tomat	39
5.2 Volatilitas Harga Sayuran di Pasar Anom Baru Sumenep.....	39
5.2.1 Deskripsi Data	39
5.2.2 Identifikasi Model ARCH-GARCH	40
5.2.2.1 Uji Autokorelasi.....	40
5.2.2.2 Pemilihan Persamaan Rataan	41
5.2.3 Pendugaan Parameter dan Pemilihan Model Terbaik ...	43
5.2.4 Pemeriksaan Model ARCH-GARCH	43
5.2.5 Perhitungan Volatilitas Kedua Sayuran.....	43
5.3 Identifikasi Pengaruh antara Jumlah Pasokan dengan Harga kedua Sayuran	45
BAB VI PENUTUP	
6.1 Kesimpulan.....	48
6.2 Saran	48
DAFTAR PUSTAKA.....	49
LAMPIRAN.....	51

DAFTAR TABEL

Tabel 1.1	Produksi Sayuran di Indonesia Tahun 2011-2015	2
Tabel 2.1	Penentuan Model ARIMA(p,d,q)	16
Tabel 4.1	Jumlah Penduduk di Kabupaten Sumenep Tahun 2015	35
Tabel 4.2	Produksi Sayuran di Kabupaten Sumenep 2011-2015.....	37
Tabel 4.3	Luas Areal panen Sayuran di Kabupaten Sumenep 2011-2015	37
Tabel 5.1	Ringkasan Statistik Data Harga Jual Kuadrat kedua Sayuran.....	40
Tabel 5.2	Pengujian Autokorelasi Kuadrat Harga Bulanan kedua Sayuran di Pasar Anom Baru Sumenep	41
Tabel 5.3	Hasil Uji Stasioneritas Data Harga kedua Sayuran	42
Tabel 5.4	Model ARIMA kedua Sayuran.....	42
Tabel 5.5	Hasil Pengujian Efek ARCH pada Residual Model ARIMA	43
Tabel 5.6	Model ARCH-GARCH Terbaik kedua Sayuran	43
Tabel 5.7	Hasil Pengujian Efek ARCH pada Residual Model ARCH-GARCH	43
Tabel 5.8	Hasil Perhitungan Volatilitas kedua Sayuran	44
Tabel 5.9	Rentang Fluktuasi Harga kedua Sayuran	45
Tabel 5.10	Hasil Pengujian Koefisien Regresi.....	46
Tabel 5.11	Hasil Uji Kointegrasi antara Jumlah Pasokan dengan Harga kedua Sayuran	47

DAFTAR GAMBAR

Gambar1.1Fluktuasi Harga bulanan Sayuran Cabai rawit dan Tomat.....	2
Gambar 2.1Kurva Permintaan	7
Gambar 2.2Kurva Penawaran.....	8
Gambar 2.3Hubungan Risiko dengan Return	11
Gambar 2.4Kerangka Berpikir.....	24
Gambar4.1Letak Lokasi Pasar Anom Baru Kabupaten Sumenep.....	34
Gambar5.1Plot Deret Waktu Harga dan Pasokan Bulanan sayuran Cabai rawit	38
Gambar5.2Plot Deret Waktu Harga dan Pasokan Bulanan sayuran Tomat.....	39

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1	Plot Data Harga Cabai Rawit.....	51
Lampiran 2	Plot Data Harga Tomat.....	51
Lampiran 3	Pengujian Autokorelasi Kuadrat Harga Sayuran Cabai Rawit...	52
Lampiran 4	Pengujian Autokorelasi Kuadrat Harga SayuranTomat.....	52
Lampiran 5	Ringkasan Statistik Untuk Data Harga Kuadrat Sayuran Cabai Rawit.....	53
Lampiran 6	Ringkasan Statistik Untuk Data Harga Kuadrat Sayuran Tomat.....	54
Lampiran 7	Pengujian Uji Stasioneran Data Harga Sayuran Cabai Rawit ...	54
Lampiran 8	Pengujian Uji Stasioneran Data Harga Sayuran Tomat	55
Lampiran9	Model ARIMA Sayuran Cabai Rawit.....	55
Lampiran 10	Model ARIMA Sayuran Tomat.....	56
Lampiran 11	Hasil Pengujian Efek ARCH pada Residual Model ARIMA Sayuran Cabai Rawit.....	56
Lampiran12	Hasil Pengujian Efek ARCH pada Residual Model ARIMA Sayuran Tomat.....	57
Lampiran 13	Model ARCH-GARCH Terbaik Sayuran Cabai Rawit	57
Lampiran 14	Model ARCH-GARCH Terbaik Sayuran Tomat.	58
Lampiran 15	Hasil Pengujian Efek ARCH Sayuran Cabai rawit	58
Lampiran 16	Hasil Pengujian Efek ARCH Sayuran Tomat	58
Lampiran 17	Hasil Uji Ljung-Box Sayuran cabai Rawit	59
Lampiran 18	Hasil Uji Ljung-Box Sayuran Tomat.....	60
Lampiran 19	Pengujian Regresi Sayuran Cabai Rawit.....	61
Lampiran 20	Pengujian Regresi Sayuran Tomat.....	61
Lampiran 21	Hasil Uji Kointegrasi Sayuran Cabai Rawit	62
Lampiran 22	Hasil Uji Kointegrasi Sayuran Tomat	62
Lampiran 23	Perhitungan nilai volatilitas	62