

Rizqi Kurnianti. NIM140321100020. Volatilitas Harga Dan Integrasi Pasar Komoditas Cabai Rawit (*Capsium Frutescent L.*) Antara Pasar Ki Lemah Duwur Dan Pasar Baru Bancaran Di Kabupaten Bangkalan. Dibawah bimbingan **Dr. Teti Sugiarti, SP., MP.**

ABSTRAK

Ketidakseimbangan jumlah permintaan cabai dengan jumlah cabai yang diproduksi mengakibatkan ketidakseimbangan harga. Tujuan penelitian ini adalah untuk mendeskripsikan kondisi fluktuasi dan menganalisis tingkat volatilitas serta integrasi pasar di Pasar Ki Lemah Duwur dan Pasar Baru Bancaran. Data yang digunakan yakni harga jual cabai rawit tahun 2014-2017. Metode penelitian yang digunakan yakni ARCH-GARCH dengan penentuan model terbaik, Uji Kointegrasi dan Uji ECM. Hasil penelitian menunjukkan tingkat volatilitas antara Pasar Ki lemah Duwur dan Pasar Baru Bancaran lemah. Namun apabila dibandingkan tingkat volatilitas Pasar Ki Lemah Duwur lebih besar dari pada Pasar Baru Bancaran yang menunjukkan tingkat risiko yang dihadapi pasar Ki Lemah Duwur lebih besar dari Pasar Baru Bancaran. Sedangkan hasil analisis kointegrasi dan uji ECM menunjukkan hubungan jangka pendek dan jangka antara Pasar Ki Lemah Duwur dan Pasar Baru Bancaran.

Kata kunci: Cabai, Volatilitas, ARCH-GARCH, Kointegrasi, Uji ECM

RIZQI KURNIANTI. 140321100020. Volatility Price And Integration Market Of Chili Between Ki Lemah Duwur Market And Baru Bancaran Market In Bangkalan Regency. Supervised by **Dr. Teti Sugiarti, SP., MP.**

ABSTRACT

The number of both supplying chili and producing chili impact the imbalance of the price itself. The objective of this research is to describing the fluctuation and analyzing the level of volatility also the market integration in Ki Lemah Duwur Market and Baru Bancaran Market. The data which is used in this research is the selling price of cayenne pepper during 2014 until 2017. The research method which are used consist of ARCH-GARCH with best stipulation model and Cointegration Test also ECM Test. The result shows that the level of volatility both of Ki Lemah Duwur Market and Baru Bancaran Market are low. But, if it compared, with the level of volatility in Ki Lemah Duwur Market is higher than Baru Bancaran Market. It means that the risk which taken from Ki Lemah Duwur Market is bigger than Baru Bancaran Market. Meanwhile the result of analyzing cointegration and ECM Test shows about the short-term relation and the long-term relation between Ki Lemah Duwur Market and Baru Bancaran Market.

Keywords: Chili, Volatility, ARCH-GARCH, Cointegration, ECM Test

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	ii
HALAMAN PENGESAHAN	iii
HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING	iv
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN KARYA ILMIAH	v
BIODATA PENULIS	vi
HALAMAN PERSEMBAHAN	vii
ABSTRAK	viii
ABSTRACT	ix
KATA PENGANTAR	x
DAFTAR ISI	xii
DAFTAR TABEL	xiii
DAFTAR GAMBAR	xiv
DAFTAR LAMPIRAN	xv
 BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	2
1.3 Tujuan Penelitian	2
1.4 Manfaat Penelitian	3
 BAB II TINJAUAN PUSTAKA	
2.1 Landasan Teori	4
2.2.1 Teori Harga	6
2.2.2 Teori Volatilitas Harga	5
2.2.3 Jenis Pasar	8
2.2.4 Integrasi Pasar	9
2.2.5 Analisis Kointegrasi	10
2.2.6 <i>Error Correction Mechanism (ECM)</i>	11
2.4 Penelitian Terdahulu	13
2.3 Kerangka Berpikir	18
 BAB III METODE PENELITIAN	
3.1 Lokasi dan Waktu Penelitian	19
3.2 Metode Pengumpulan Data	19
3.3 Metode Analisis Data	19
3.3.1 Analisis Deskriptif	
3.3.2 Analisis Volatilitas Harga Dengan Model ARCH-GARCH	20
3.3.2 Analisis Kointegrasi	22
3.3.4 Uji (ECM)	23
3.4 Definisi Operasional	24
 BAB IV GAMBARAN UMUM LOKASI PENELITIAN	
4.1 Kabupaten Bangkalan	25
4.1.1 Kondisi Geografis	25
4.1.2 Kondisi Penduduk	25
4.1.3 Kondisi Pertanian	27

4.2 Profil Pasar	28
4.2.1 Pasar Ki Lemah Duwur	28
4.2.2 Pasar Baru Bancaran	29
BAB V HASIL DAN PEMBAHASAN	
5.1 Deskripsi Fluktuasi Harga Komoditas Cabai Rawit Di Pasar Ki Lemah Duwur dan Pasar Baru Bancaran	30
5.2 Analisis Volatilitas Komoditas Harga Cabai Rawit	35
5.2.1 Tahap Identifikasi	35
5.2.2 Tahap Estimasi Model Arima	36
5.2.3 Tahap Evaluasi Model	37
5.2.4 Tingkat Volatilitas Komoditas Harga Cabai Rawit	38
5.3 Analisis Integrasi Pasar Komoditas Cabai Rawit Di Pasar Ki Lemah Duwur dan Pasar Baru Bancaran	40
5.3.1 Uji Stationeritas Data	40
5.3.2 Uji Kointegrasi	41
5.3.3 Uji ECM	42
BAB VI PENUTUP	
6.1 Simpulan	44
6.2 Saran	44
DAFTAR PUSTAKA	45
LAMPIRAN	48

DAFTAR TABEL

Tabel 5.1	Statistik Deskriptif Variabel Harga Cabai Rawit.....	36
Tabel 5.2	Hasil Uji Stationeritas (Uji <i>Augmented Dickey Fuller</i>).....	36
Tabel 5.3	Model Arima Terbaik	37
Tabel 5.4	Hasil Uji Efek ARCH Terhadap Model ARIMA Terbaik	37
Tabel 5.5	Pemilihan Model ARCH/GARCH Terbaik.....	38
Tabel 5.6	Hasil Uji Normalitas dan Uji ARCH-LM	38
Tabel 5.7	Hasil Uji ADF Pada Tingkat <i>Level Dan First Diifference</i> Pada Pasar Ki Lemah Duwur Dan Pasar Baru Bancaran Pada Tingkat <i>Trend and Intercept</i>	40
Tabel 5.8	Hasil Uji Kointegrasi Pengaruh Harga Cabai Rawit di Pasar Ki Lemah Duwur Terhadap Pasar Baru Bancaran	41
Tabel 5.9	Hasil Uji ECM	42

DAFTAR GAMBAR

Gambar 2.1	Grafik Keseimbangan Penawaran dan Permintaan	5
Gambar 2.2	Pengaruh Selisih Pasokan Dan Permintaan Cabai Terhadap Harga Cabai.....	6
Gambar 2.3	Kerangka Berpikir	18
Gambar 4.1	Jenis Pekerjaan Penduduk Kabupaten Bangkalan Tahun 2016.....	26
Gambar 4.2	Kontribusi Produksi Cabai Rawit Di Jawa Timur Tahun 2016.....	28
Gambar 5.1	Grafik Harga Jual Rata-Rata Komoditas Cabai Rawit Di Pasar Ki Lemah Duwur dan Pasar Baru Bancaran Tahun 2014 – 2017	30
Gambar 5.2	Grafik Harga Jual Rata-Rata Komoditas Cabai Rawit Di Pasar Ki Lemah Duwur dan Pasar Baru Bancaran Tahun 2014.....	31
Gambar 5.3	Grafik Harga Jual Rata-Rata Komoditas Cabai Rawit Di Pasar Ki Lemah Duwur dan Pasar Baru Bancaran Tahun 2015.....	32
Gambar 5.4	Grafik Harga Jual Rata-Rata Komoditas Cabai Rawit Di Pasar Ki Lemah Duwur dan Pasar Baru Bancaran Tahun 2016.....	33
Gambar 5.5	Grafik Harga Jual Rata-Rata Komoditas Cabai Rawit Di Pasar Ki Lemah Duwur dan Pasar Baru Bancaran Tahun 2017.....	34

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran 1. Harga Cabai Rawit Di Pasar Ki Lemah Duwur dan Pasar Baru Bancaran Pada Tahun 2014 – 2017	48
Lampiran 2. Grafik Pergerakan Harga Cabai Rawit Di Pasar Ki Lemah Duwur dan Pasar Baru Bancaran Pada Tahun 2014 – 2017 ...	49
Lampiran 3. Grafik Pergerakan Harga Cabai Rawit Di Pasar Baru Bancaran Pada Tahun 2014 – 2017	50
Lampiran 4. Statistik Deskriptif Pasar Ki Lemah Duwur	50
Lampiran 5. Statistik Deskriptif Pasar Baru Bancaran	51
Lampiran 6. Hasil Uji Stationeritas (Uji Augmented Dickey Fuller) Pasar Ki. Lemah Duwur.....	51
Lampiran 7. Hasil Uji Stationeritas (Uji Augmented Dickey Fuller) Pasar Baru Bancaran	53
Lampiran 8. Model MA (0,0,1) Variabel Pasar Ki Lemah Duwur	55
Lampiran 9. Model MA (0,0,1) Variabel Pasar Baru Bancaran	55
Lampiran 10. Hasil Evaluasi Unsur ARCH pada Pasar Ki Lemah Duwur	56
Lampiran 11. Hasil Evaluasi Unsur ARCH pada Pasar Baru Bancaran.....	57
Lampiran 12. Model GARCH (2,2) Pada Variabel Pasar Ki Lemah Duwur....	58
Lampiran 13. Model GARCH (2,2) Pada Variabel Pasar Baru Bancaran	59
Lampiran 14. Evaluasi Model GARCH (2,2) Pada Pasar Ki Lemah Duwur ...	59
Lampiran 15. Evaluasi Model GARCH (2,2) Pada Pasar Baru Bancaran.....	60
Lampiran 16. Uji Kointegrasi Pada Variabel Pasar Ki Lemah Duwur Dan Pasar Baru Bancaran	60
Lampiran 17. Hasil Uji ECM.....	61