

**ANALISIS VOLATILITAS HARGA DAGING SAPI DI  
PROVINSI KEPULAUAN BANGKA BELITUNG**

**SKRIPSI**



**PIPIT  
2051411027**

**PROGRAM STUDI AGRIBISNIS FAKULTAS  
PERTANIAN PERIKANAN DAN BIOLOGI  
UNIVERSITAS BANGKA BELITUNG  
2018**

**ANALISIS VOLATILITAS HARGA DAGING SAPI DI  
PROVINSI KEPULAUAN BANGKA BELITUNG**

**PIPIT  
2051411027**

Skripsi

Sebagai Salah Satu Syarat untuk Memperoleh Gelar Sarjana Pertanian  
di Program Studi Agribisnis

**PROGRAM STUDI AGRIBISNIS FAKULTAS  
PERTANIAN PERIKANAN DAN BIOLOGI  
UNIVERSITAS BANGKA BELITUNG  
2018**

## HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN PENELITIAN

Dengan ini saya, Pipit menyatakan bahwa skripsi yang saya tulis adalah hasil karya sendiri dan skripsi ini belum pernah diajukan sebagai pemenuhan untuk memperoleh gelar atau derajat kesarjanaan strata satu (S1) dari Universitas Bangka Belitung maupun Perguruan Tinggi lainnya.

Semua informasi yang dimuat dalam skripsi ini yang berasal dari penulis lain, baik yang dipublikasikan maupun yang tidak dipublikasikan telah penulis cantumkan nama sumber penulisnya secara benar dan semua isi skripsi ini sepenuhnya menjadi tanggung jawab saya sebagai penulis.

Balunujuk, Agustus 2018



*Pipit*  
Pipit



## HALAMAN PENGESAHAN

Judul Skripsi : Analisis Volatilitas Harga Daging Sapi di Provinsi Kepulauan  
Bangka Belitung

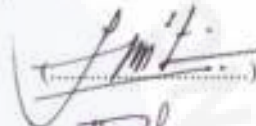
Nama : Pipit

NIM : 2051411027

Skripsi ini, telah dipertahankan dihadapan majelis penguji pada hari Selasa, 31 Juli 2018 dan telah diterima sebagai salah satu syarat untuk memperoleh gelar Sarjana Pertanian.

### Komisi Penguji

Ketua : Iwan Setiawan, S.P., M.Si

()

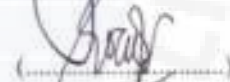
Anggota 1 : Rati Purwasih, S.P., M.Si

()

Anggota 2 : Yudi Sapta Pranoto, S.P., M.Si

()

Anggota 3 : Dr. Evahelda, S.T.P., M.Si

()

Balunijuk, Agustus 2018

Mengetahui

Ketua Program Studi Agribisnis



  
Yudi Sapta Pranoto, S.P., M.Si

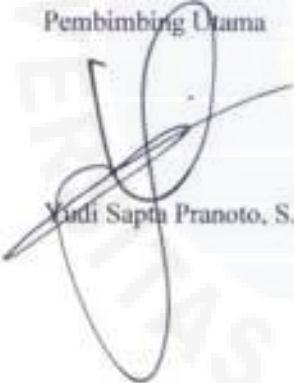
Tanggal Lulus :

**ANALISIS VOLATILITAS HARGA DAGING SAPI DI  
PROVINSI KEPULAUAN BANGKA BELITUNG**

**PIFIT  
2051411027**

Telah diterima sebagai salah satu syarat untuk memperoleh gelar  
Sarjana Pertanian

Pembimbing Utama

  
Yudi Sapta Pranoto, S.P., M.Si

Pembimbing Pendamping

  
Dr. Evahelda, S.T.P., M.Si

Balunijuk, Agustus 2018

Dekan  
Fakultas Pertanian Perikanan dan Biologi  
Universitas Bangka Belitung

  
Dr. Tri Lestari, S.P., M.Si

## ABSTRAK

**Pipit (2051411027).** Analisis Volatilitas Harga Daging Sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung. (Pembimbing : Yudi Sapta Pranoto dan Evahelda)

Harga daging sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung cenderung berfluktuasi pada 10 tahun terakhir. Fluktuasi harga dapat menyebabkan volatilitas harga yang tinggi. Penelitian ini bertujuan untuk (1) menganalisis volatilitas harga daging sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung dan (2) menganalisis faktor-faktor yang mempengaruhi volatilitas harga daging sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung. Data yang digunakan dalam penelitian ini adalah data *time series* periode Januari 2007 sampai Desember 2016. Alat analisis yang digunakan dalam penelitian ini adalah analisis model ARCH-GARCH (*Autoregressive Conditional Heteroscedasticity* (ARCH) dan *Generalized Autogressive Conditional Heteroscedasticity* (GARCH)) dan analisis model VAR/VECM (*Vector Autoregression* (VAR) atau *Vector Error Correction Model* (VECM)) dengan bantuan aplikasi *Eviews 8.0*. Hasil penelitian menunjukkan bahwa volatilitas harga daging sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung rendah dengan nilai koefisien ARCH sebesar 0,513111 dan akan bertahan dalam jangka waktu yang lama dengan koefisien GARCH sebesar 0,743361. Faktor-faktor yang mempengaruhi volatilitas harga daging sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung dalam jangka panjang yaitu harga daging sapi domestik dengan nilai presentase sebesar 5,60692, suku bunga dengan nilai presentase sebesar 3,41990 dan nilai tukar rupiah dengan nilai presentase sebesar 4,03446. Pada jangka pendek tidak terdapat faktor yang mempengaruhi volatilitas harga daging sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung.

**Kata kunci:** ARCH-GARCH, Fluktuasi harga, Harga daging sapi, VAR/VECM, Volatilitas

## **ABSTRACT**

**Pipit (2051411027).** *Price Volatility Analysis Of Beef In Province Of Bangka Belitung Islands* (Supervised : Yudi Sapta Pranoto dan Evahelda)

*The price of beef in the Province of Bangka Belitung Islands are inclined to fluctuate in the last 10 years. Price fluctuations can cause price volatility is high. This study aims to (1) analyze the volatility of the price of beef in the Province of Bangka Belitung Island and (2) analyze the factors that affect the volatility of the price of beef in the Province of Bangka Belitung Island. The Data used in this study is time series data for the period of January 2007 to December 2016. Analysis tools used in this research is the analysis of the model ARCH-GARCH (Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (ARCH) and Generalized Autogressive Conditional Heteroscedasticity (GARCH)) and the analysis of the VAR model/VECM (Vector Autoregression (VAR) or Vector Error Correction Model (VECM)) with the aid of Eviews 8.0. The results showed that the volatility of the price of beef in the Province of Bangka Belitung Islands is low with a value of the coefficient of ARCH of 0,513111 and will survive in the long term with the coefficient of GARCH by 0,743361. The factors that affect the volatility of the price of beef in the Province of Bangka Belitung in the long run the price of domestic beef with the value of the percentage of 5,60692, the interest rate with the value of the percentage of 3,41990 and the rupiah exchange rate with the value of the percentage of 4,03446. In the short term there are factors that affect the volatility of the price of beef in the Province of Bangka Belitung.*

**Keywords:** *ARCH-GARCH, Price fluctuations, the Price of beef, Volatilit, VAR/VECM*

## KATA PENGANTAR

Puji dan syukur penulis panjatkan atas kehadiran Allah SWT yang telah memberikan rahmat dan karunianya sehingga penulis dapat menyelesaikan Skripsi ini dengan baik. Tak lupa juga shalawat dan salam kepada junjungan kita Nabi Muhammad SAW yang telah membawa kita ke zaman yang terang benderang seperti saat ini. Skripsi ini berjudul **"Analisis Volatilitas Harga Daging Sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung"** yang merupakan salah satu syarat untuk memperoleh gelar Sarjana Pertanian di Program Studi Agribisnis Fakultas Pertanian Perikanan dan Biologi.

Pada kesempatan ini penulis ingin menyampaikan banyak terimakasih kepada pihak yang telah memberikan penulis bimbingan, arahan serta masukan yang bermanfaat. Ucapan terimakasih ini penulis sampaikan kepada :

1. Kedua orang tua Ayahanda Sardin dan Ibunda Junati yang selalu sabar dan mendo'akan keberhasilan penulis.
2. Saudara-saudara penulis Parizan, Parnono, Zirwanto, Irpin, Arwani dan Susan Septri Yana.
3. Bapak Yudi Sapta Pranoto, S.P., M.Si selaku Ketua Jurusan Agribisnis Fakultas Pertanian, Perikanan dan Biologi Universitas Bangka Belitung.
4. Bapak Yudi Sapta Pranoto, S.P., M.Si dan Ibu Dr. Evahelda, S.T.P., M.Si selaku dosen pembimbing pertama dan dosen pembimbing pendamping yang telah banyak memberikan nasehat, bimbingan serta waktunya selama penelitian dan penulisan skripsi ini.
5. Bapak Iwan Setiawan, S.P., M.Si dan Rati Purwasih, S.P., M.Si selaku dosen penguji dalam kolokium, seminar hasil dan siding komprehensif.
6. Bapak Pusat Statistik Provinsi Kepulauan Bangka Belitung, Badan Pusat Statistik Indonesia dan Bank Indonesia yang telah memberikan data kepada penulis selama penelitian.
7. Seluruh dosen dan staf Jurusan Agribisnis yang telah berseia membagi waktu, ilmu dan pengalaman selama penulis menjalani masa perkuliahan.
8. Sahabat sekost seperjuangan penulis yakni Tuti, Nalupiza dan Ima.



9. Sahabatku seperjuangan terbaik Siska, Yulia dan Widya serta sahabat seperjuangan kuliah yaitu semua mahasiswa Agribisnis angkatan 2014.
10. Semua pihak yang telah ikut serta membantu baik materi maupun masukan selama penyusunan skripsi ini.

Penulis menyadari bahwa skripsi ini masih banyak kekurangan, oleh karena itu kritik dan saran yang bersifat membangun dari pembaca sangat perlu diberikan kepada penulis. Akhir kata penulis berharap semoga skripsi ini bermanfaat bagi semua pihak.

Balunjuk, Agustus 2018

Penulis



## DAFTAR ISI

Halaman

HALAMAN JUDUL	
HALAMAN PERNYATAAN KEASLIAN PENELITIAN	
HALAMAN PENGESAHAN	
HALAMAN PERSETUJUAN SKRIPSI	
ABSTRAK	
<i>ABSTRACT</i>	
KATA PENGANTAR	
DAFTAR ISI.....	iii
DAFTAR TABEL .....	v
DAFTAR GAMBAR.....	vi
DAFTAR LAMPIRAN .....	vii
<b>I. PENDAHULUAN.....</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah .....	5
1.3 Tujuan Penelitian.....	5
1.4 Kegunaan Penelitian.....	5
<b>II. TINJAUAN PUSTAKA.....</b>	<b>7</b>
2.1 Landasan Teori .....	7
2.1.1 Deskripsi Sapi .....	7
2.1.2 Volatilitas .....	7
2.1.3 Konsep Harga.....	9
2.1.4 Konsep Risiko .....	14
2.1.5 Model ARCH/GARCH.....	16
2.2 Penelitian Terdahulu.....	21
2.3 Kerangka Pemikiran .....	28
2.4 Definisi Operasional .....	29
2.5 Hipotesis .....	30

<b>III. METODOLOGI PENELITIAN.....</b>	<b>31</b>
3.1 Tempat dan Waktu Penelitian .....	31
3.2 Metode Penelitian.....	31
3.3 Metode Pengumpulan Data .....	31
3.4 Metode Pengolahan dan Analisis Data.....	32
<b>IV. HASIL DAN PEMBAHASAN.....</b>	<b>40</b>
4.1 Gambaran Umum Lokasi Penelitian Provinsi Kepulauan Bangka Belitung .....	40
4.2 Volatilitas Harga Daging Sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung.....	45
4.3 Pengaruh Harga Daging Sapi Domestik, Inflasi, Nilai Tukar Rupiah dan Suku Bunga Terhadap Volatilitas Harga Daging Sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung.....	56
<b>V. SIMPULAN DAN SARAN.....</b>	<b>66</b>
5.1 Simpulan.....	66
5.2 Saran .....	66
<b>DAFTAR PUSTAKA.....</b>	<b>67</b>
<b>LAMPIRAN</b>	

## DAFTAR TABEL

	<b>Halaman</b>
Tabel 1 Populasi Ternak Sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung Tahun 2012-2016 .....	2
Tabel 2 Produksi Daging Sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung Tahun 2012-2016 .....	3
Tabel 3 Penelitian Terdahulu .....	21
Tabel 4 Metode Pengolahan dan Analisis Data .....	32
Tabel 5 Jumlah Penduduk Provinsi Kepulauan Bangka Belitung Berdasarkan Umur dan Jenis Kelamin Tahun 2016.....	42
Tabel 6 Jumlah Produksi dan Jumlah Konsumsi (Ton) Daging Sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung .....	45
Tabel 7 Uji Stasioneritas Data .....	49
Tabel 8 Uji ARIMA .....	50
Tabel 9 Uji ARCH-LM.....	51
Tabel 10 Ringkasan Kriteria untuk Pemilihan Model Terbaik .....	52
Tabel 11 Uji Stasioneritas Data .....	57
Tabel 12 Hasil Penentuan Lag Optimal .....	58
Tabel 13 Uji Stabilitas Model VAR.....	59
Tabel 14 Uji Kointegrasi.....	60
Tabel 15 Hasil Estimasi VECM.....	61

## DAFTAR GAMBAR

	<b>Halaman</b>
Gambar 1 Perkembangan Harga Daging Sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung Tahun 2012-2016.....	4
Gambar 2 Pembentukan Harga oleh Permintaan dan Penawaran .....	14
Gambar 3 Hubungan Risiko dan <i>Return</i> .....	15
Gambar 4 Skema Kerangka Pemikiran Analisis Volatilitas Daging Sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung Tahun 2012-2016.....	28
Gambar 5 Tren Data Perkembangan Harga Daging Sapi di Provinsi Kepulauan Bangka Belitung.....	46
Gambar 6 Perkembangan Harga Daging Sapi Provinsi Kepulauan Bangka Belitung dan Domestik (Nasional) Tahun 2007-2016 .....	47
Gambar 7 <i>Conditional Standart Deviation</i> (CSD) Harga Daging Sapi Provinsi Kepulauan Bangka Belitung .....	55

## DAFTAR LAMPIRAN

	<b>Halaman</b>
Lampiran 1 Harga Daging Sapi Provinsi Kepulauan Bangka Belitung, Harga Daging Sapi Domestik, Inflasi Provinsi Kepulauan Bangka Belitung, Nilai Tukar Rupiah dan Suku Bunga .....	71
Lampiran 2 Uji Stasioneritas Pada Tingkat Level .....	75
Lampiran 3 Uji Stasioneritas Pada Tingkat <i>First Difference</i> .....	76
Lampiran 4 Korelogram Q-statistik ACF dan PACF.....	78
Lampiran 5 Uji ARIMA.....	79
Lampiran 6 Korelogram Q-statistik ACF dan PACF Setelah ARIMA.....	81
Lampiran 7 Uji ARCH-LM.....	82
Lampiran 8 Uji ARCH (1) .....	82
Lampiran 9 Uji GARCH (1,1) .....	83
Lampiran 10 Uji ARCH-M .....	83
Lampiran 11 Uji TARARCH.....	84
Lampiran 12 Uji EGARCH.....	85
Lampiran 13 Uji ARCH-LM dan <i>Normality Test</i> dari Model Terpilih .....	86
Lampiran 14 Simpangan Baku Bersyarat .....	86
Lampiran 15 Hasil Penentuan Lag Optimal.....	87
Lampiran 16 Uji Stabilitas Model VAR .....	87
Lampiran 17 Uji Kointegrasi .....	88
Lampiran 18 Hasil Estimasi VECM .....	91