

TESIS

**ANALISIS VOLATILITAS HARGA KOMODITAS PANGAN
DI PROVINSI KALIMANTAN SELATAN
DAN PENGARUHNYA TERHADAP INFLASI**



ELLY FITRIYANA

**PROGRAM STUDI MAGISTER EKONOMI PERTANIAN
FAKULTAS PERTANIAN
UNIVERSITAS LAMBUNG MANGKURAT
BANJARBARU**

2025

**ANALISIS VOLATILITAS HARGA KOMODITAS PANGAN
DI PROVINSI KALIMANTAN SELATAN
DAN PENGARUHNYA TERHADAP INFLASI**

Oleh:

ELLY FITRIYANA

2120524320032

Tesis sebagai salah satu syarat
untuk mendapatkan gelar Magister Ekonomi Pertanian
pada
Program Studi Magister Ekonomi Pertanian Fakultas Pertanian
Universitas Lambung Mangkurat

**PROGRAM STUDI MAGISTER EKONOMI PERTANIAN
FAKULTAS PERTANIAN
UNIVERSITAS LAMBUNG MANGKURAT
BANJARBARU**

2025

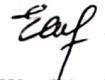
PERNYATAAN KEASLIAN TULISAN

Saya yang bertanda tangan dibawah ini:

Nama : Elly Fitriyana
Nomor Induk Mahasiswa : 2120524320032
Program Studi Pascasarjana : Ekonomi Pertanian
Universitas Lambung Mangkurat

Menyatakan bahwa penelitian yang saya buat dengan judul: “**Analisis Volatilitas Harga Komoditas Pangan di Provinsi Kalimantan Selatan dan Pengaruhnya terhadap Inflasi**” merupakan hasil gagasan dan karya sendiri di bawah arahan komisi pembimbing, kecuali yang dengan jelas ditunjukkan rujukannya. Tugas akhir ini belum pernah diajukan dalam bentuk apapun kepada perguruan tinggi mana pun. Sumber informasi yang berasal atau dikutip dari karya yang diterbitkan maupun yang tidak diterbitkan dari penulis lain telah disebutkan dalam teks dan dicantumkan dalam daftar pustaka di bagian akhir tesis ini.

Banjarbaru, Juni 2025
Yang membuat pernyataan,



Elly Fitriyana
NIM. 2120524320032

RINGKASAN

Elly Fitriyana. Analisis Volatilitas Harga Komoditas Pangan di Provinsi Kalimantan Selatan dan Pengaruhnya terhadap Inflasi. Dibawah bimbingan H. Muhammad Husaini dan H. Hamdani.

Penelitian ini bertujuan menganalisis volatilitas harga beras, minyak goreng dan daging ayam ras dan pengaruhnya terhadap nilai inflasi selama periode Tahun 2014-2023 di Provinsi Kalimantan Selatan dengan menggunakan data sekunder (*time series*) harga beras, minyak goreng dan daging ayam ras ditingkat konsumen dan tingkat inflasi untuk waktu 10 tahun yaitu Tahun 2014-2023. Data sekunder diperoleh dari Badan Pusat Statistik Provinsi Kalimantan Selatan dan Dinas Pertanian dan Ketahanan Pangan Provinsi Kalimantan Selatan. Metode yang digunakan untuk menganalisis volatilitas menggunakan metode analisis ARCH/GARCH. Sedangkan untuk menganalisis pengaruh volatilitas harga beras, minyak goreng, dan daging ayam ras terhadap inflasi digunakan metode analisis ARDL (*Autoregressive Distributed Lag*).

Hasil penelitian menunjukkan bahwa volatilitas harga beras tergolong rendah (0,892) dan bernilai kurang dari 1 sehingga tingkat volatilitas beras pada periode yang akan datang akan semakin besar dan kecenderungan terjadinya volatilitas akan berlangsung lama. Volatilitas harga minyak goreng tergolong tinggi (1,02) karena bernilai lebih dari 1 sehingga jika harga minyak goreng tidak dikontrol dengan baik maka volatilitas yang tinggi akan terjadi pada waktu yang lama. Volatilitas harga daging ayam ras tergolong rendah (0,680) dan bernilai kurang dari 1.

Berdasarkan model ARDL (4,2,0,4) menunjukkan bahwa dalam jangka pendek volatilitas harga beras (pada lag 2), volatilitas harga minyak goreng (pada lag 0), dan volatilitas harga daging ayam ras pada (periode saat ini dan lag 4) berpengaruh signifikan terhadap inflasi. Sedangkan dalam jangka panjang, hanya volatilitas harga beras saja yang berpengaruh signifikan terhadap inflasi di Provinsi Kalimantan Selatan.

Kata kunci: Harga Komoditas Pangan, Volatilitas, Inflasi dan Kalimantan Selatan

SUMMARY

Elly Fitriyana. Analysis of Food Commodity Price Volatility in South Kalimantan Province and Its Impact on Inflation. Supervised by Muhammad Husaini dan Hamdani.

This study aims to analyze the price volatility of rice, cooking oil and broiler chicken and its effect on inflation during the period 2014-2023 in South Kalimantan Province using secondary data (time series) of rice, cooking oil and broiler chicken prices at the consumer level and inflation rates for 10 years, namely 2014-2023. Secondary data were obtained from the Central Statistics Agency of South Kalimantan Province and the Department of Agriculture and Food Security of South Kalimantan Province. The method used to analyze volatility uses the ARCH/GARCH analysis method. Meanwhile, to analyze the effect of rice, cooking oil and broiler chicken price volatility on inflation, the ARDL (Autoregressive Distributed Lag) analysis method was used in this study.

The results of the study indicate that the volatility of rice prices is relatively low (0,892) and has a value of less than 1 so that the level of rice volatility in the coming period will be greater and the tendency for volatility to occur will last a long time. The volatility of cooking oil prices is relatively high (1,02) because it has a value of more than 1 so that if the price of cooking oil is not controlled properly, high volatility will occur for a long time. The volatility of broiler chicken prices is relatively low (0,680) and has a value of less than 1.

Based on the ARDL model (4,2,0,4) shows that in the short term, rice price volatility (at lag 2), cooking oil price volatility (at lag 0), and broiler chicken price volatility (current period and lag 4) have a significant effect on inflation. While in the long term, only rice price volatility has a significant effect on inflation in South Kalimantan Province.

Keywords: Food Commodity Prices, Volatility, Inflation, South Kalimantan

Judul : Analisis Volatilitas Harga Komoditas Pangan di Provinsi Kalimantan Selatan dan Pengaruhnya terhadap Inflasi
Nama : Elly Fitriyana
NIM : 2120524320032

Disetujui,
Komisi Pembimbing

Ketua

Anggota



Dr. Ir. Muhammad Husaini, MS.
NIP. 19590705 198603 1 003



Prof. Dr. Ir. H. Hamdani, MS.
NIP. 19591218 198703 1 003

Diketahui,

Koordinator Program Studi Magister
Ekonomi Pertanian

Dekan Fakultas Pertanian
Universitas Lambung Mangkurat



Dr. Ir. Sadik Hksan, DAD, M.Sc.
NIP. 19640314 198903 1 004



Prof. A. Rizalli Sady, S.P., M.Agr.Sc., Ph.D.
NIP. 19690425 199512 1 001

Tanggal Lulus: 5 Juni 2025

Tanggal Wisuda:

SERTIFIKAT BEBAS PLAGIASI

NOMOR : 034/JUN8.1.23/DV.02.05/2025

Sertifikat ini diberikan kepada:

ELLY FITRIYANA

Dengan Judul Tesis :

Analisis Volatilitas Harga Komoditas Pangan di Provinsi Kalimantan Selatan dan Pengaruhnya terhadap Inflasi

Telah dideteksi tingkat plagiasinya dengan kriteria toleransi $\leq 20\%$, dan dinyatakan Bebas dari Plagiasi.

Banjarbaru, 7 Juli 2025

a.n. Dekan

Wakil Dekan Bidang Akademik,



Prof. Dr. Ir. Ika Sumantri, S.Pt., M.Si., M.Sc., IPM

NIP. 197308071998031003



KATA PENGANTAR

Puji syukur penulis panjatkan kehadirat Allah SWT berkat rahmat dan hidayah-Nya, penulis dapat menyelesaikan laporan tesis dengan judul “Analisis Volatilitas Harga Komoditas Pangan di Provinsi Kalimantan Selatan dan Pengaruhnya Terhadap Inflasi”. Tesis ini disusun untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh gelar Magister Ekonomi Pertanian pada Universitas Lambung Mangkurat. Dalam penyusunan tesis ini penulis memperoleh arahan, bimbingan dan masukan dari berbagai pihak, maka penulis mengucapkan terima kasih kepada:

1. Dekan Fakultas Pertanian Universitas Lambung Mangkurat beserta seluruh staf yang mendukung kegiatan belajar mengajar.
2. Dr. Ir. Sadik Ikhsan, DAD, M.Sc. selaku Ketua Program Studi Magister Ekonomi Pertanian Universitas Lambung Mangkurat.
3. Dosen Program Magister Ekonomi Pertanian Universitas Lambung Mangkurat yang telah mengupayakan alih pengetahuan dan pengalaman sebagai bekal penulis dalam menyusun proposal tesis ini.
4. Dr. Ir. H. Muhammad Husaini, MS. selaku dosen pembimbing pertama, yang telah bekerja keras dan penuh kesabaran memberikan bimbingan serta arahan dalam penyusunan proposal tesis ini.
5. Prof. Dr. Ir. H. Hamdani, MS. selaku pembimbing kedua, yang telah memberikan banyak masukan dan sarana serta bimbingan dalam penyusunan proposal tesis ini.

Penulis menyadari bahwa penelitian ini masih jauh dari sempurna baik isi maupun susunannya. Oleh karena itu, saran dan kritik yang membangun sangat penulis harapkan demi perbaikan selanjutnya. Akhir kata, penulis berharap semoga informasi dalam tulisan ini dapat bermanfaat.

Banjarbaru, Juni 2025



Elly Fitriyana

DAFTAR RIWAYAT HIDUP



ELLY FITRIYANA, lahir di Gambut, 04 Juni 1999, anak pertama dari empat bersaudara, dari pasangan bapak Muhammad Yasir dan ibu Mahmudah. Selama hidupnya penulis telah menyelesaikan pendidikan di Madrasah Ibtidaiyyah Negeri (MIN) Model Martapura, lulus tahun 2011. Kemudian penulis melanjutkan sekolah di Madrasah Tsanawiyah Negeri (MTsN) Model Darussalam Martapura, lulus tahun 2014. Setelah itu penulis melanjutkan pendidikan ke Sekolah Menengah Atas Negeri (SMAN) 1 Martapura dengan mengambil jurusan Matematika & Ilmu Pengetahuan Alam (MIPA) dan lulus pada tahun 2017. Pada tahun 2021 menyelesaikan studi Program Sarjana (S1) pada program studi Agribisnis Fakultas Pertanian Universitas Lambung Mangkurat Banjarbaru laporan skripsi yang berjudul “Evaluasi Pelaksanaan Program Asuransi Usahatani Padi (AUTP) pada Dua tipe Lahan Lebak di Kabupaten Hulu Sungai Utara”. Selanjutnya pada tahun 2022 sampai dengan sekarang bekerja sebagai tenaga kontrak pada Dinas Pertanian dan Ketahanan Pangan Provinsi Kalimantan Selatan. Pada bulan November 2024 sampai dengan bulan Juni 2025 penulis melaksanakan penelitian dengan judul laporan tesis “Analisis Volatilitas Harga Komoditas Pangan di Provinsi Kalimantan Selatan dan Pengaruhnya Terhadap Inflasi” sebagai salah satu syarat untuk menyelesaikan studi Program Magister (S2) pada program studi Ekonomi Pertanian Universitas Lambung Mangkurat Banjarbaru.

DAFTAR ISI

	Halaman
DAFTAR ISI	i
DAFTAR GAMBAR	ii
DAFTAR TABEL	iii
DAFTAR LAMPIRAN	iv
PENDAHULUAN	1
Latar Belakang	1
Rumusan Masalah	8
Tujuan Penelitian.....	8
Manfaat Penelitian.....	8
TINJAUAN PUSTAKA.....	10
Harga	10
Teori Harga.....	10
Teori Permintaan dan Penawaran	12
Faktor yang Mempengaruhi Harga Komoditas Pangan	16
Volatilitas.....	17
Pengertian Volatilitas	17
Faktor Penyebab Volatilitas Harga	19
Inflasi.....	20
Pengertian Inflasi	20
Teori Inflasi	21
Faktor yang Menyebabkan Terjadinya Inflasi	23
Penelitian Terdahulu.....	24
LANDASAN TEORI.....	26
ARCH – GARCH dalam Analisis Volatilitas	26
Uji Stasioneritas	28
Pemilihan Model ARIMA	29

Uji ARCH <i>Effect</i>	30
ARCH-GARCH <i>Method</i>	31
Autoregressive Distributed Lag (ARDL)	32
Model Distributed Lag	32
Uji Stasioneritas Data.....	35
Pemilihan Orde Lag	35
Uji Kointegrasi.....	36
Estimasi Model ARDL.....	37
Uji Asumsi dalam ARDL	37
Stabilitas Parameter.....	38
Kerangka Pemikiran Konseptual.....	39
METODE PENELITIAN	41
Waktu dan Tempat	41
Jenis dan Sumber Data	41
Analisis Data.....	41
Hipotesis Penelitian	54
Definisi Operasional Variabel.....	54
HASIL DAN PEMBAHASAN	56
Volatilitas Harga Komoditas Pangan (Beras, Minyak Goreng dan Daging ayam ras) Periode Tahun 2014-2023 di Provinsi Kalimantan Selatan.....	56
Uji Stasioneritas	58
Model ARIMA.....	59
Uji Heteroskedastisitas dan ARCH <i>Effect</i>	65
ARCH-GARCH <i>Method</i>	66
Perhitungan Nilai Volatilitas	68
Pengaruh Volatilitas Harga Komoditas Pangan (Beras, Minyak Goreng dan Daging ayam ras dan) Terhadap Inflasi Selama Periode Tahun 2014-2023 Di Provinsi Kalimantan Selatan.....	76
Pengujian Stasioneritas Data	78
Orde Lag	79

Uji Kointegrasi Bound Test	80
Hubungan Jangka Pendek Antara Inflasi Dan Volatilitas Harga Pada Beras, Minyak Goreng dan Daging Ayam Ras	85
Pengaruh Inflasi Periode Sebelumnya.....	86
Pengaruh Volatilitas Harga Beras terhadap Inflasi	88
Pengaruh Volatilitas Harga Minyak Goreng terhadap Inflasi.....	88
Pengaruh Volatilitas Harga Daging Ayam Ras terhadap Inflasi.....	88
Hubungan Jangka Panjang Antara Inflasi dan Volatilitas Harga Pada Beras, Minyak Goreng dan Daging Ayam Ras	89
KESIMPULAN DAN SARAN	93
Kesimpulan	93
Saran	93
DAFTAR PUSTAKA	95
LAMPIRAN	97

DAFTAR GAMBAR

Nomor	Halaman
1. Tingkat Inflasi Bulanan Indonesia Tahun 2019-2023.....	2
2. Harga Beras, Minyak Goreng, Daging ayam ras Provinsi Kalimantan Selatan Tahun 2019-2023	5
3. Tingkat Inflasi Provinsi Kalimantan Selatan Bulan Januari – Juli 2023	6
4. Pembentukan Harga oleh Permintaan dan Penawaran	14
5. Pergeseran Kurva Permintaan.....	14
6. Pergeseran Kurva Penawaran	15
7. Kerangka Pemikiran Konseptual	40
8. Perkembangan harga rata-rata bulanan beras dan minyak goreng di Provinsi Kalimantan Selatan tahun 2014-2023	56
9. Perkembangan harga rata-rata bulanan daging ayam ras di Kalimantan Selatan tahun 2014-2023	57
10. Pola ACF dan PACF pada Variabel Komoditas Beras	60
11. Pola ACF dan PACF pada Variabel Komoditas Minyak Goreng	62
12. Pola ACF dan PACF pada Variabel Komoditas Daging Ayam Ras	63
13. Pola Volatilitas Komoditas Beras di Kalimantan Selatan periode tahun 2014-2023	70
14. Pola Volatilitas Komoditas Minyak Goreng di Provinsi Kalimantan Selatan periode 2014-2023	73
15. Pola Volatilitas Komoditas Daging Ayam Ras di Provinsi Kalimantan Selatan periode 2014-2023	76
16. Inflasi year on year Kalimantan Selatan periode 2014-2023	77
17. Berbagai Orde Lag Model ARDL Untuk Inflasi dan Volatilitas Harga pada Beras, Minyak Goreng dan Daging Ayam Ras	80
18. Garis CUSUM dan CUSUM Q pada tingkat signifikansi 5%	85

DAFTAR TABEL

Nomor	Halaman
1. Diagram Timbang Indeks Harga Konsumen Provinsi Kalimantan Selatan Tahun 2023.....	4
2. Hasil Uji Stasioneritas Variabel Harga Beras, Minyak Goreng Dan Daging Ayam Ras Menggunakan Uji ADF	59
3. Hasil Pemodelan ARIMA Komoditas Beras, Minyak Goreng dan Daging Ayam Ras	64
4. Hasil Uji Heteroskedastisitas pada Model ARIMA Terpilih untuk Komoditas Beras, Minyak Goreng dan Daging Ayam Ras Selatan Tahun 2022.....	66
5. Hasil Analisis Model ARCH/GARCH Komoditas Beras, Minyak Goreng Dan Daging Ayam Ras	68
6. Volatilitas Komoditas Beras engan model ARCH 1.....	69
7. Volatilitas Komoditas Minyak Goreng dengan Model GARCH (1,1) .	72
8. Volatilitas Komoditas Daging Ayam Ras dengan Model GARCH 1 ...	75
9. Uji Stasioneritas Pada Variabel Inflasi, Volatilitas Harga Beras, Volatilitas Harga Minyak Goreng dan Volatilitas Harga Daging Ayam Ras	79
10. Hasil Uji Kointegrasi Hubungan Jangka Panjang Variabel Inflasi dan Volatilitas Harga Beras, Minyak Goreng dan Daging Ayam Ras	81
11. Hasil Uji Normalitas Model ARDL (4,2,0,4) pada Variabel Inflasi dan Volatilitas Harga Beras, Minyak Goreng dan Daging Ayam Ras	82
12. Hasil Uji Homoskedastisitas Model ARDL (4,2,0,4) pada Variabel Inflasi dan Volatilitas Harga Beras, Minyak Goreng dan Daging Ayam Ras	83
13. Hasil Uji Non-Autokorelasi Model ARDL (4,2,0,4) pada Variabel Inflasi dan Volatilitas Harga Beras, Minyak Goreng dan Daging Ayam Ras	83

14. Hasil Estimasi Model ARDL Jangka Pendek Antara Inflasi dan Volatilitas Harga Pada Komoditas Beras, Minyak Goreng dan Daging Ayam Ras	87
15. Estimasi Model ARDL Hubungan Jangka Panjang Antara Inflasi dan Volatilitas Harga Beras, Minyak Goreng dan Daging Ayam Ras	90

DAFTAR LAMPIRAN

Nomor	Halaman
1. Uji stasioneritas pada harga beras, minyak goreng, dan daging ayam ras	98
2. Uji model ARIMA variabel harga beras	100
3. Uji Model ARIMA variabel harga minyak goreng ARIMA minyak goreng (1,1,1)	105
4. Uji model ARIMA variabel harga daging ayam ras ARIMA daging ayam ras (2,1,0)	109
5. Uji Heteroskedastisitas model ARIMA harga beras (3,1,7) dan (7,1,3)	112
6. Uji Heteroskedastisitas model ARIMA harga minyak goreng (1,1,1)	113
7. Uji Heteroskedastisitas model ARIMA harga minyak goreng (1,1,1)	114
8. Uji model ARIMA beras terpilih (3,1,7) dengan metode ARCH/GARCH	115
9. Uji model ARIMA beras terpilih (7,1,3) dengan metode ARCH/GARCH	117
10. Uji model ARIMA minyak goreng terpilih (1,1,1) dengan metode ARCH/GARCH	119
11. Uji stasioneritas pada nilai inflasi dengan metode ARCH/GARCH	121
12. Uji stasioneritas pada nilai inflasi	122
13. Uji stasioneritas pada nilai volatilitas harga beras pada tingkat level...	123
14. Uji stasioneritas pada nilai volatilitas harga minyak goreng pada tingkat level	124
15. Uji stasioneritas pada nilai volatilitas harga daging ayam ras pada tingkat level	125
16. Uji pemilihan orde lag pada model ARDL inflasi dan volatilitas harga beras, minyak goreng, dan daging ayam ras	126

17. Uji kointegrasi <i>Bound-Test</i>	130
18. Uji normalitas residual model ARDL (4,2,0,4)	131
19. Uji homoskedastisitas model ARDL (4,2,0,4)	132
20. Uji non-autokorelasi model ARDL (4,2,0,4).....	133
21. Uji stabilitas model ARDL (4,2,0,4).....	134
22. Uji hubungan jangka pendek model ARDL (4,2,0,4) antara nilai inflasi dan volatilitas harga beras, minyak goreng, dan daging ayam ras	135
23. Uji hubungan jangka panjang model ARDL (4,2,0,4) antara nilai inflasi dan volatilitas harga beras, minyak goreng, dan daging ayam ras	136