

ANALISIS *CONNECTEDNESS* RATA-RATA *RETURN* HARGA BERAS DI JAWA BARAT MENGGUNAKAN PENDEKATAN VAR DAN *SPILLOVER* DIEBOLD-YILMAZ

CINDY SINTHIA CENDANI



**DEPARTEMEN ILMU EKONOMI
FAKULTAS EKONOMI DAN MANAJEMEN
INSTITUT PERTANIAN BOGOR
BOGOR
2025**



@Hak cipta milik IPB University

Hak Cipta Dilindungi Undang-undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB University.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB University.

PERNYATAAN MENGENAI SKRIPSI DAN SUMBER INFORMASI SERTA PELIMPAHAN HAK CIPTA

Dengan ini saya menyatakan bahwa skripsi dengan judul “Analisis *Connectedness* Rata-Rata *Return* Harga Beras di Jawa Barat Menggunakan Pendekatan VAR dan *Spillover* Diebold-Yilmaz” adalah karya saya dengan arahan dari dosen pembimbing dan belum diajukan dalam bentuk apa pun kepada perguruan tinggi mana pun. Sumber informasi yang berasal atau dikutip dari karya yang diterbitkan maupun tidak diterbitkan dari penulis lain telah disebutkan dalam teks dan dicantumkan dalam Daftar Pustaka di bagian akhir skripsi ini.

Dengan ini saya melimpahkan hak cipta dari karya tulis saya kepada Institut Pertanian Bogor.

Bogor, Februari 2025

Cindy Sinthia Cendani
NIM. H1401211030



ABSTRAK

CINDY SINTHIA CENDANI. Analisis *Connectedness* Rata-Rata *Return* Harga Beras di Jawa Barat Menggunakan Pendekatan VAR dan *Spillover* Diebold-Yilmaz. Dibimbing oleh IMAN SUGEMA.

Penelitian ini menganalisis keterkaitan (*connectedness*) dan efek *spillover* rata-rata *return* harga beras antarwilayah pasar di Jawa Barat selama periode 2017-2024 dengan menggunakan pendekatan *Vector Autoregressive* (VAR) dan *Spillover* Diebold-Yilmaz. Data yang digunakan merupakan data sekunder berupa harga rata-rata harian dari lima wilayah di Jawa Barat, yaitu Kota Bandung, Kota Bogor, Kota Cirebon, Kabupaten Cirebon, dan Kota Tasikmalaya. Penelitian ini melibatkan analisis data *time series* dan *rolling windows* 300 hari. Hasil penelitian menunjukkan adanya *connectedness* yang signifikan antarwilayah pasar dalam pergerakan harga beras, yang mengindikasikan efek *spillover* yang kuat. Pengaruh harga beras di suatu wilayah pasar terhadap wilayah pasar lainnya dapat menyebabkan ketidakseimbangan pasar dan memengaruhi stabilitas harga. Temuan ini diharapkan dapat menjadi acuan bagi pemerintah dalam merumuskan kebijakan distribusi dan stabilisasi harga beras yang lebih efektif serta memberikan informasi bagi masyarakat mengenai dinamika pasar beras.

Kata kunci: beras, *connectedness* harga, Jawa Barat, *spillover*, VAR

ABSTRACT

CINDY SINTHIA CENDANI. Analysis of the *Connectedness* of Average Rice Price Returns in West Java Using the VAR and Diebold-Yilmaz *Spillover* Approaches. Supervised by IMAN SUGEMA.

This study analyses the *connectedness* and *spillover* effects of the average return on rice prices across market regions in West Java during the 2017-2024 period using the *Vector Autoregressive* (VAR) and Diebold-Yilmaz *Spillover* approaches. The data used consists of secondary data in the form of daily average prices from five regions in West Java, namely Bandung City, Bogor City, Cirebon Regency, and Tasikmalaya City. This research involves time series data analysis and 300 day rolling windows approach. The findings indicate significant *connectedness* between regions in rice price movements, suggesting a strong *spillover* effect. The influence of rice prices in one region on others may cause market imbalances and affect price stability. These findings are expected to serve as a reference for the government in formulating more effective distribution and price stabilization policies and provide valuable insights for the public on rice market dynamics.

Keywords: price *connectedness*, rice, *spillover*, VAR, West Java



Hak Cipta Dilindungi Undang-undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB University.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB University.

© Hak Cipta milik IPB, tahun 20XX¹
Hak Cipta dilindungi Undang-Undang

Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan atau menyebutkan sumbernya. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik, atau tinjauan suatu masalah, dan pengutipan tersebut tidak merugikan kepentingan IPB.

Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apa pun tanpa izin IPB.



- 

ANALISIS *CONNECTEDNESS* RATA-RATA *RETURN* HARGA BERAS DI JAWA BARAT MENGGUNAKAN PENDEKATAN VAR DAN *SPILLOVER* DIEBOLD-YILMAZ

CINDY SINTHIA CENDANI

Skripsi
sebagai salah satu syarat untuk memperoleh gelar
Sarjana pada
Program Studi Ekonomi Pembangunan

**DEPARTEMEN ILMU EKONOMI
FAKULTAS EKONOMI DAN MANAJEMEN
INSTITUT PERTANIAN BOGOR
BOGOR
2025**



@Hak cipta milik IPB University

Hak Cipta Dilindungi Undang-undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber :
 - a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik atau tinjauan suatu masalah
 - b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IPB University.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IPB University.

Tim Penguji pada Ujian Skripsi:

- 1 Dr.rer.pol. Deniey Adi Purwanto, S.E, M.S.E.
- 2 Syarifah Amaliah, S.E, M.App.Ec.

Judul Skripsi : Analisis *Connectedness* Rata-Rata *Return* Harga Beras di Jawa Barat Menggunakan Pendekatan VAR dan *Spillover* Diebold-Yilmaz

Nama : Cindy Sinthia Cendani
NIM : H1401211030

Pembimbing 1:
Dr.Ir. Iman Sugema, M.Ec.

Disetujui oleh



Diketahui oleh

Ketua Program Studi:
Dr. Tony Irawan, S.E, M.App.Ec.
NIP 198203062005011000



Tanggal Ujian:
26 Februari 2025

Tanggal Lulus:

PRAKATA

Puji dan syukur penulis panjatkan kepada Allah *Subhanaahu Wa Ta'ala* atas segala karunia-Nya sehingga karya ilmiah ini berhasil diselesaikan. Tema yang dipilih dalam penelitian yang dilaksanakan sejak bulan November 2024 sampai bulan Februari 2025 ini ialah ekonomi moneter, perbankan, dan keuangan dengan judul “Analisis *Connectedness* Rata-Rata *Return* Harga Beras di Jawa Barat Menggunakan Pendekatan VAR dan *Spillover* Diebold-Yilmaz”.

Penulis menyadari bahwa penyelesaian karya ilmiah ini tidak lepas dari bantuan dan dukungan berbagai pihak. Oleh karena itu, penulis ingin mengucapkan terima kasih kepada semua yang telah berkontribusi dalam proses penelitian ini yakni kepada:

1. Bapak Dr. Ir. Iman Sugema, M.Ec. selaku dosen pembimbing yang telah memberikan bimbingan, arahan, dan motivasi yang sangat berarti selama proses penelitian ini.
2. Bapak Ade Holis dan Kak Aisyah selaku asisten dosen pembimbing yang telah membantu penulis dalam memahami berbagai konsep dan teknik yang digunakan dalam penelitian ini.
3. Bapak Sabikun, Ibu Riyanti, Kakak Lilis Dyah Pramesti, Adik Tegar Kurnia Saputra serta seluruh keluarga penulis yang terus memberikan doa, dukungan, dan kasih sayangnya yang menjadi sumber semangat bagi penulis.
4. Teman seperbimbingan yaitu Kania Narasya dan Mutiara Karunia yang telah berbagi pengalaman dan saling mendukung dalam menyelesaikan penelitian ini.
5. Sahabat sahabat penulis Hana, Aisyah, Trian, Rafi, Arya, Angel, dan Zakiyah yang selalu memberikan dukungan moral dan semangat.
6. Teman-teman KKN, Azka, Indy, Khansa, Afifah, Dhiya, Reza, dan Mursyidan yang telah bersama-sama menjalani pengalaman berharga dan saling mendukung satu sama lain.
7. Teman-teman magang, Kak Layalia, Maryam, Ghefira, Mutiara, Audy, dan Najwa yang telah memberikan inspirasi dan kolaborasi yang sangat berharga bagi penulis.
8. Seluruh dosen, staf, dan civitas akademik Departemen Ilmu Ekonomi yang telah memberikan ilmu dan dukungan yang sangat berharga.
9. Teman-teman Program Studi Ekonomi Pembangunan angkatan 58 yang telah bersama-sama menjalani proses belajar dan berbagi pengalaman.

Penulis berharap semoga karya ilmiah ini dapat memberikan manfaat dan kontribusi bagi pengembangan ilmu pengetahuan, khususnya dalam bidang ekonomi. Kritik dan saran yang konstruktif sangat diharapkan untuk perbaikan di masa mendatang.

Bogor, 5 Februari 2025

Cindy Sinthia Cendani

DAFTAR ISI

DAFTAR TABEL	x
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN	x
I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	4
1.3 Tujuan	4
1.4 Manfaat	5
1.5 Ruang Lingkup	5
II TINJAUAN PUSTAKA	6
2.1 Teori Permintaan dan Penawaran	6
2.2 Komoditas Beras	8
2.3 Konsep <i>Spillover</i>	9
2.4 <i>Daily Price Return</i>	10
2.5 Keterkaitan (<i>Connectedness</i>) <i>Spillovers</i> pada Harga Beras	11
2.6 Studi Terdahulu	11
2.7 Kerangka Pemikiran	13
2.8 Hipotesis Penelitian	14
III METODE	15
3.1 Jenis dan Sumber Data	15
3.2 Metode Analisis	16
IV HASIL DAN PEMBAHASAN	24
4.1 Kondisi Umum Harga Beras Provinsi Jawa Barat	24
4.2 Hasil Estimasi <i>Vector Autoregressive</i> (VAR)	24
4.3 Hasil Analisis <i>Spillovers</i> Diebold-Yilmaz	28
IV SIMPULAN DAN SARAN	39
5.1 Simpulan	39
5.2 Saran	39
DAFTAR PUSTAKA	41
LAMPIRAN	45
RIWAYAT HIDUP	55



DAFTAR TABEL

1	Data pasar tradisional di Provinsi Jawa Barat berdasarkan kabupaten/kota	15
2	Variabel dan sumber data	16
3	<i>Connectedness Table</i>	21

DAFTAR GAMBAR

1	Jumlah produksi beras di Jawa Barat tahun 2018-2022	1
2	Harga beras di pasar tradisional berdasarkan komoditas (Rupiah/kg) di Provinsi Jawa Barat tahun 2022-2024	3
3	Kurva permintaan linear	6
4	Kurva penawaran	7
5	Kerangka pemikiran	14
6	Rata-rata harga beras bulanan di tingkat penggilingan menurut kualitas tahun 2023	24
7	Dekomposisi variansi (<i>return</i>) antarwilayah	28
8	Total <i>Volatility Spillovers</i>	31
9	<i>Directional volatility spillovers, "from others"</i>	33
10	<i>Directional volatility spillovers, "to others"</i>	34
11	<i>Net Directional Spillovers</i>	35
12	<i>Net Pairwise Spillovers</i>	37
13	<i>Robustness Assessment</i>	38

DAFTAR LAMPIRAN

1	Hasil uji stasioneritas ADF <i>test</i>	46
2	Hasil uji stabilitas VAR	48