UNIVERSITAS
GADJAH MADA
Struktur jala (Lattice) untuk model runtun waktu atas dinamika indeks Yen terhadap Rupiah melalui proses adaptif
SYOFIAN, Andi, Prof. Adhi Susanto, MSc.,PhD
Universitas Gadjah Mada, 2003 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

INTISARI

Peramalan dengan sistem adaptif berhubungan erat dengan pengidentifikasian dan pemodelan. Pada penelitian ini digunakan Struktur Jala *(lattice)* untuk proses adaptasinya. Struktur Jala *(lattice)* yang dicobakan adalah satu tingkat, dua tingkat dan tiga tingkat. Informasi disampaikan melalui data, dan sistem adaptif akan menyaring informasi tersebut melalui pelatihan (pembelajaran). Proses adaptasi akan berhasil dengan mantap, bila isyarat keluaran yang dihasilkan berupa derau putih (*white noise*).

Untuk banyak langkah prediksi tergantung kepada jumlah tundaan yang diberikan pada proses adaptasinya. Pada penelitian ini, pola/perilaku indeks yen terhadap rupiah berbeda pada masa sebelum krisis ekonomi tahun 1995 – 1997 dan masa setelah krisis ekonomi tahun 1997 - 2002. Hasil prediksi atas nilai indeks yen terhadap rupiah sekarang berhubungan erat dengan nilai indeks yen terhadap rupiah pada masa sebelumnya. Pengujian keakuratan prediksi dilakukan dengan membandingkan data hasil prediksi dengan data aslinya. Pada penelitian ini rerata keakuratan prediksi mencapai 99% untuk struktur jala *(lattice)* satu tingkat, dua tingkat, dan tiga tingkat.

Kata kunci: Sistem adaptif, struktur jala *(lattice)*, derau putih, tundaan, prediksi indeks yen terhadap rupiah.

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
Struktur jala (Lattice) untuk model runtun waktu atas dinamika indeks Yen terhadap Rupiah melalui proses adaptif
SYOFIAN, Andi, Prof. Adhi Susanto, MSc.,PhD
Universitas Gadjah Mada, 2003 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

ABSTRACT

In adaptive process, with some lattice structures, was employed in a predictive configuration. The first, second, and third lattice grades were tested to model some time series by monitoring the residual error. One, two, and three steps ahead prediction schemes were investigated for the Indonesian currency exchange rate in the period of the years 1995 up to 2002.

The results show clearly the two stationary segment, viz the exchange rate data before the last quarted of 1997 and after January 1998, due to the Indonesian currency crisis at the of 1997.

Using the models obtained, prediction tests showed that accuracies of about 99 % was reached, for the first, second, and third grade lattice structure.

Key words: Adaptive process, lattice structures, and prediction