

DAFTAR GAMBAR

Gambar 1.1:	Kurs harian rupiah terhadap USD 2008-2017.....	1
Gambar 1.2:	Perbandingan antara asumsi APBN dan realisasi nilai tukar rupiah terhadap USD tahun 2008-2017.....	2
Gambar 1.3:	Realisasi nilai tukar rupiah terhadap USD hingga Juli 2018....	3
Gambar 2.1:	Signaling Theory.....	13
Gambar 2.2:	Contoh Discrete Time Series: GDP Indonesia dari tahun 2008 sampai dengan 2017.....	19
Gambar 2.3:	Penggambaran ayunan pendulum setelah terimpact di $t=1$ dalam basis waktu (t).....	20
Gambar 2.4:	Contoh stasioneritas: (a) stasioner di nilai rata-rata (<i>mean</i>); (b) non-stasioner di nilai rata-rata (<i>mean</i>) dan (c) non-stasioner di nilai rata-rata (<i>mean</i>) dan varian.....	21
Gambar 2.5:	Plot data time series (atas) dan koefisien autokorelasinya (bawah).....	22
Gambar 2.6:	Konfigurasi <i>neural network</i> : <i>input layer-hidden layer-ouput layer</i>	25
Gambar 2.7:	Implementasi training metode <i>backpropagation</i> untuk satu Neuron.....	27
Gambar 2.8:	Bagan Kerangka Pemikiran Penelitian.....	40
Gambar 4.1:	Uji stasioneritas secara visual nilai tukar mata uang Rupiah terhadap USD.....	50
Gambar 4.2:	Hasil uji stasioneritas dengan metode ADF untuk data nilai tukar Rupiah terhadap USD.....	52
Gambar 4.3:	Uji Autokorelasi untuk <i>scatter plot</i> : (a) nilai $y(t)$ terhadap waktu dan (b) nilai $y(t-1)$ terhadap nilai $y(t)$	54
Gambar 4.4:	Uji Autokorelasi untuk <i>scatterplot</i> : (a) nilai <i>return</i> (t) terhadap waktu dan (b) nilai <i>return</i> ($t-1$) terhadap nilai <i>return</i> (t).....	55
Gambar 4.5:	Uji <i>Correlogram</i> data <i>return</i> (<i>differencing</i> pertama).....	57
Gambar 4.6:	Uji Heteroskedastisitas secara visual.....	59

Gambar 4.7:	Uji Heteroskedastisitas dengan metode <i>Park</i> pada data residual.....	60
Gambar 4.8:	Parameter GARCH(1,0,1) pada nilai tukar mata uang rupiah terhadap USD.....	61
Gambar 4.9:	Uji Heteroskedastisitas dengan metode <i>Park</i> pada model GARCH(1,0,1).....	62
Gambar 4.10:	Model BP-ANN untuk <i>training</i> data nilai tukar mata uang rupiah terhadap USD.....	65
Gambar 4.11:	Perbandingan plot nilai aktual dan nilai hasil proyeksi model ARIMA(1,1,1)-GARCH untuk proyeksi jangka Panjang.....	68
Gambar 4.12:	Perbandingan plot nilai aktual dan nilai hasil proyeksi model BP-ANN untuk proyeksi jangka Panjang.....	69
Gambar 4.13:	Perbandingan plot proyeksi jangka panjang BP-ANN untuk EPOCH=10, 100 dan 1000.....	71