Implementasi automatic trading system pada perdagangan valas

Arasi Ramli

Deskripsi Dokumen: <http://lib.ui.ac.id/opac/ui/detail.jsp?id=111177&lokasi=lokal>

Abstrak

Saat ini pasar valas berkembang dengan pesat. Pasar valas yang sebelumnya didominasi oleh pasar interbank (interbank market), kini menjadi semakin ramai dengan berkembangnya pasar valas ritel. Hal ini ditandai oleh munculnya broker valas lokal maupun internasional. Didukung oleh perkembangan teknologi informasi dan komunikasi, perdagangan valas menjadi semakin mudah dan cepat. Trader dapat dengan mudah bertransaksi melalui internet, PDA, telepon seluler, fax, dan media komunikasi lainnya.

Banyak broker menawarkan fasilitas khusus untuk menarik minat trader dan calon trader, mulai dari platform perdagangan yang cepat dan mudah dengan layanan yang kontinu (24 jam) sampai dengan biaya spread yang murah. Salah satu fasilitas yang menarik lainnya adalah kapabilitas automatic trading system. Automatic Trading System adalah fasilitas yang memungkinkan trader memprogram strategi perdagangannya agar transaksi perdagangannya dapat dilakukan secara otomatis tanpa atau sedikit-tidakunya campur tangan trader.

Tujuan penulisan karya akhir ini adalah :

- Memperkenalkan kemampuan automatic trading system dalam melakukan perdagangan secara kontinu, akurat, dan konsisten.
- Memberikan guide line pembangunan automatic trading system
- Memberikan contoh implementasi automatic trading system sederhana menggunakan indikator moving average, bollinger band, dan MACD beserta uji coba dan analisisnya

Berdasarkan hasil uji coba dan analisis dapat disimpulkan bahwa automatic trading system dapat melakukan perdagangan secara kontinu, akurat, dan konsisten. Proses monitor berlangsung selama 24 jam sehari dan sinyal beli dan jual yang muncul terdeteksi dengan akurat secara real time dan konsisten.

Pemilihan indikator yang digunakan dalam menerapkan strategi perdagangan sangat mempengaruhi tingkat profitabilitas sistem. Strategi perdagangan yang kompleks cenderung mengungguli strategi perdagangan yang lebih sederhana. Hal ini terlihat pada hasil uji coba di mana strategi perdagangan yang menggunakan indikator MACD mengungguli strategi perdagangan yang menggunakan bollinger band dan moving average dalam menghasilkan return investasi.