

Implementasi automatic trading system pada perdagangan valas

Arasi Ramli, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?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 setidaknya mengurangi 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 tereksekusi 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.

Forex market is booming nowadays. Forex market, which was previously dominated by interbank market, has become more crowded with the booming of retail market. Forex trading is becoming easier and faster, supported by the development of information and communication technology. Traders can easily execute transaction using internet, PDA, fixed and mobile phone, fax, and other communication devices.

A lot of forex brokers offer special facilities to attract traders, ranging from easy and fast trading platform

with 24 hours services to low cost spread. One of the interesting facilities is automatic trading system capability. The automatic trading system is a facility that allows traders to program their trading strategies in order to automate all their transactions or at least to reduce traders' intervention.

The purposes of this research are the following:

- To introduce automatic trading system capability in order to perform continuous, accurate, and consistent trading.
- To provide the guideline in the development process of automatic trading system.
- To provide examples of implementation of simple automatic trading systems using moving average, Hollinger hand, and MAC) technical indicators as well as its test.

Result and analysis.

Based on the test result and analysis, automatic trading system has the capability to perform continuous, accurate, and consistent trading. The monitoring process runs 24 hours a day and the trading signals are executed accurately and consistently in a real time manner. Technical indicator selection that is applied in trading strategies affects system profitability.

Complex trading strategies tends to be better than the simples ones. It is shown on the test result that trading strategy using MACD indicator provide better result than trading strategies using Bollinger band and moving average.