

Pemanfaatan data mining dengan pendekatan support vector machine untuk prediksi arah pergerakan mata uang = The use of data mining with support vector machine approach for prediction of currency movements / Handy Chandra

Handy Chandra, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20365514&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Perdagangan dan hubungan antar negara menyebabkan pertukaran mata uang antar negara atau lebih dikenal dengan forex atau foreign exchange. Pasar mata uang memiliki kapitalisasi yang sangat besar, sehingga perdagangan mata uang ini telah menjadi salah satu pilihan investasi. Meskipun investasi dalam pasar mata uang adalah investasi yang beresiko tinggi atau high risk, akan tetapi investasi ini juga menjanjikan hasil yang tinggi atau high return. Banyak faktor yang mempengaruhi pergerakan mata uang, salah satu faktor utamanya adalah berita fundamental. Berita fundamental adalah berita tentang kondisi perekonomian suatu negara.

Kesuksesan dalam perdagangan mata uang, para pelaku perdagangan mata uang harus memiliki kemampuan dalam melakukan analisis pergerakan mata uang. Pedagang mata uang harus menguasai analisis teknis dan analisis fundamental dalam melakukan analisis pergerakan mata uang. Namun pada kenyataannya banyak pelaku perdagangan mata uang mengalami kerugian besar yang disebabkan perbedaan persepsi antara pasar mata uang dengan analisis teknis maupun analisis fundamental yang telah dilakukan. Hal ini disebabkan karena analisis teknis dan analisis fundamental yang dilakukan bersifat konvensional dengan beberapa periode waktu saja. Dan disamping itu pedagang mata uang belum menguasai emosi dalam melakukan transaksi perdagangan mata uang.

Penelitian ini bertujuan membuat model pengambilan keputusan jual atau beli dengan menggunakan model data mining yang melibatkan data historis perdagangan masa lampau dan waktu dimana berita fundamental dikeluarkan oleh lembaga berwenang suatu negara. Dengan menggunakan data historis ini akan dibuatkan model data mining dalam pengambilan keputusan perdagangan tanpa melibatkan manusia. Metode data mining yang dipergunakan adalah Support Vector Machine (SVM) dalam melakukan klasifikasi dan pengenalan pola. SVM ini akan dipergunakan untuk mengambil keputusan jual atau beli berdasarkan indikator teknis dan waktu pengumuman berita fundamental dikeluarkan.

ABSTRACT

Trade relations between the state and led to cross-border currency exchange or better known as foreign exchange. The currency market has a very large capitalization, so that currency trading has become one of the investment options. Although the investment in the currency market is a high risk investment, but these investments also promises high yield or high return. Many factors affect currency movements, one of the main factors is the fundamental news. Fundamental news is news about the condition of the economy of a country. Currency traders use fundamental news as an indicator to predict the economic conditions of a

country and its effect on the country's currency.

Success in currency trading, currency traders should have the ability to perform analysis of currency movements. Currency traders must master the technical analysis and fundamental analysis in the analysis of currency movements. But in fact many currency traders suffered huge losses due to the difference in perception between the currency markets with technical analysis and fundamental analysis has been done. This is due to the technical analysis and fundamental analysis is conventional with some periods of time. And besides that currency traders have not mastered the emotion in the transaction currency trading.

This research aims to create a model of selling or buying decisions using data mining models that involve historical data and trading period of time where the fundamental news issued by the authority of a country. By using this historical data will be creating data mining models in decision making without human involvement. The data mining method used is the Support Vector Machine (SVM) to do classification and pattern recognition. SVM will be used to make a decision to sell or buy based on technical indicators and fundamental news announcements released time.