

RANCANG BANGUN STRATEGI PERDAGANGAN FOREIGN EXCHANGE MENGGUNAKAN ROBOT FOREX DENGAN PENDEKATAN TIME FRAME

KAUTSAR PATRIOT BORNINOKA

Program Studi Teknik Informatika - S1, Fakultas Ilmu Komputer, Universitas Dian Nuswantoro Semarang

URL : <http://dinus.ac.id/>

Email : 111200904696@mhs.dinus.ac.id

ABSTRAK

Penelitian ini ditujukan untuk merancang dan membangun strategi perdagangan foreign exchange menggunakan robot forex. Pembangunan robot forex menggunakan pendekatan kerangka waktu (time frame) sebagai acuan utama dalam analisis sistemnya. Penelitian ini menggunakan 4 robot forex dengan kombinasi time frame yang berbeda. Dengan perlakuan yang sama, robot forex yang telah dirancang dan dibangun akan di evaluasi dengan metode backward test menggunakan historis data perdagangan forex selama 10 tahun dari Tahun 2003 hingga 2013 dengan kriteria evaluasi meliputi, Kecepatan Analisis Tren Harga, Prosentase Keberhasilan Yang Tinggi, dan Resiko Kecil. Hasil dari uji dan evaluasi sistem robot forex adalah robot nomor 4 memenuhi semua kriteria evaluasi yang ditetapkan pada penelitian ini. Walaupun memiliki total perdagangan paling sedikit yaitu sebanyak 136 perdagangan, akan tetapi prosentase perdagangan yang berhasil memiliki nilai yang paling besar, yaitu 61%. Dari 4 robot forex yang di uji coba, hanya robot 4 yang mendapatkan profit plus dan robot 4 memiliki prosentase drawdown terendah diantara robot yang lainnya yaitu hanya sebesar 1,98%. Hasil ini mengindikasikan rancangan robot forex pada penelitian ini cocok digunakan untuk penentuan strategi perdagangan jangka panjang.

Kata Kunci : Robot Forex, Time Frame, Kriteria Evaluasi, Backward Test, Drawdown

ENGINEERING FOR STRATEGY OF FOREIGN EXCHANGE TRADE USING FOREX ROBOT WITH TIME FRAME APPROACH

KAUTSAR PATRIOT BORNINOKA

*Program Studi Teknik Informatika - S1, Fakultas Ilmu
Komputer, Universitas Dian Nuswantoro Semarang*

URL : <http://dinus.ac.id/>

Email : 111200904696@mhs.dinus.ac.id

ABSTRACT

This research aimed is to design and build foreign exchange trading strategies using forex robots. Forex robot development approaching to time frame as the main reference in the analysis system. This research uses a forex robot with a 4 combination of different time frames. With the same treatment, forex robot which has been designed and built will be evaluated with backward test method uses historical forex trade data for 10 years from 2003 to 2013 with the evaluation criteria such as fast reaction, High Percentage of successful, and Low Risk . The results of the test and evaluation system forex robot is robot number 4 are qualified all the evaluation criteria established in this study. Although it has the total trade of at least as many as 136 trade, but the percentage of successful trades has the greatest value (61%). From 4 forex robot was tested, only robot number 4 are can getting profit plus and robot 4 has the lowest percentage of drawdown among another robot, that is only 1.98%. These results is indicate forex robot design in this study is suitable for the determination of long-term trading strategies.

Keyword : Forex Robot, Time Frame, Evaluation Criteria, Backward Test, Drawdown