

## ABSTRAK

**Adi RAharjo, 1103676. “ANALISIS OPTIMASI INVESTASI MENGGUNAKAN SISTEM “CHAOS TRADING” PADA PASANGAN MATA UANG GREAT BRITAIN POUNDSTERLING DAN US DOLLAR (STUDI TAHUN 2011)”, di bawah bimbingan Prof. Dr. H. Dadang Sadeli M.Si dan Dr. Ikaputera Waspada, MM**

Pasar valuta asing adalah suatu pasar atau tempat di mana individu-individu, berbagai perusahaan multinasional dan kalangan perbankan mengadakan jual beli atas berbagai jenis mata uang dari berbagai negara atau valuta asing. Transaksi valuta asing dilakukan untuk mengurangi resiko dan juga mencari keuntungan jangka pendek dari selisih kurs. Untuk mengurangi resiko dari transaksi valuta asing maka diperlukan prediksi (peramalan) pergerakan harga valuta asing.

Tujuan investor adalah mendapatkan return optimum pada kondisi pasar apapun, terutama pasar uang yang dinamis dan bergerak acak namun linear, pasangan mata uang Great Britain Poundsterling dan US Dollar (GBPUSD) merepresentasikan pergerakan pasar tersebut. Pada tesis ini diteliti dan dianalisis penggunaan sinyal beli dan sinyal jual, kemudian dianalisis return dan optimasinya.

Perancangan penelitian ini adalah konklusif deskriptif, yaitu dirancang sebagai alat bantu dalam pengambilan keputusan dalam menentukan, mengevaluasi, dan memilih alternatif yang terbaik dalam memecahkan suatu masalah dengan menggunakan metode yang mengumpulkan, menyajikan, serta menganalisis fakta-fakta yang relevan, sehingga akan terbentuk suatu gambaran yang cukup jelas dan komprehensif. Semua data diperoleh dari hasil transaksi metode chaos trading yang direpresentasikan atau dilakukan *backtest* menggunakan aplikasi Metatrader dengan periode 2 januari sampai dengan 31 Desember 2011 dengan berbagai macam parameter kelompok data. Hasil transaksi ini berupa data yang kemudian diolah, hingga diketahui kelompok mana yang memiliki Return positif. Dari data tersebut dipilih yang memiliki return tertinggi untuk dilakukan optimasi return. Hasil optimasi return kemudian diuji normalitas, uji korelasi, linearitas, dan regresi dari persamaan yang didapat.

Hasil penelitian menunjukkan bahwa berinvestasi di perdagangan matauang GBPUSD pada pasar valuta asing dengan menggunakan Sistem *chaos trading* dapat menguntungkan. Hasil Penelitian ini juga menunjukkan bahwa *Return* investasi yang positif dapat dioptimasi untuk mendapatkan *return* investasi yang lebih besar dengan uji dan *optimization sistem* yang terdapat pada terminal Metatrader. Dari hasil penelitian ini juga dapat diketahui ketika *Return* dioptimalkan, maka Risiko pun secara linier meningkat pula. Hal ini menguatkan pandangan bahwa *Return* dan Risiko selalu bergerak linear, ketika *Return* tinggi maka Risikonya pun tinggi, sebaliknya ketika Risikonya rendah maka *Return* yang dihasilkan menjadi rendah pula.

**Kata Kunci:** Analisis teknikal, chaos trading, analisis optimasi investasi, risk dan return.

## ABSTRACT

**Adi RAHARJO, 1103676. INVESTMENT ANALYSIS USING OPTIMIZATION SYSTEM" TRADING CHAOS "IN THE CURRENCY PAIR GREAT BRITAIN POUNDS STERLING AND U.S. DOLLAR (STUDIES IN 2011), under the guidance and supervision of Prof. Dr. H. Dadang Sadeli, MSi and Dr. Ikaputera Waspada, MM**

*The foreign exchange market is a place where individuals, multi-national corporations and banks hold a sale and purchase of various types of currency from different countries. Foreign exchange transactions carried out to reduce the risk and also seek short-term gains from exchange. To reduce the risk of foreign exchange transactions it will require prediction or forecasting.*

*Investors aim is to get the optimum return on any market conditions, The market movement is dynamic and random, the pair Poundsterling Great Britain and the U.S. Dollar (GBPUSD) represents the movement of the market. In this thesis, researched and analyzed is using a buy signal and sell signal, then analyzed and the optimization return.*

*The design of this study is conclusive descriptive, which is designed as a tool in decision-making in determining, evaluating, and selecting the best alternative in solving a problem using the method of collecting, presenting, and analyzing the relevant facts. All data obtained from the transaction method of trading that represented is backtesting using Metatrader application with the period 2 January to 31 December 2011 with a many range of parameter data sets. This transaction results in the form of data then processed, which group is known to have a positive return. From the data that have been the highest return, it will be optimization return and then tested for normality return optimization, correlation test, linearity, and the regression equation obtained.*

*Results of research show that investing in GBPUSD-exchange trading in the foreign exchange market using chaos trading system can be profitable. The study results also showed that the positive investment return can be optimized to obtain a greater investment return with testing and optimization systems in Metatrader terminal. Th results of this study may also be known as Return optimized, then the risk was linearly increased as well. This reinforces the view that the Return and Risk always moving linearly, when the risk is high return is high, otherwise when the risk is low, the return generated is low.*

*Keywords: Technical analysis, trading chaos, optimization of investment analysis, risk and return.*