



Hak cipta dan penggunaan kembali:

Lisensi ini mengizinkan setiap orang untuk menggubah, memperbaiki, dan membuat ciptaan turunan bukan untuk kepentingan komersial, selama anda mencantumkan nama penulis dan melisensikan ciptaan turunan dengan syarat yang serupa dengan ciptaan asli.

Copyright and reuse:

This license lets you remix, tweak, and build upon work non-commercially, as long as you credit the origin creator and license it on your new creations under the identical terms.

BAB I

PENDAHULUAN

1.1 Latar Belakang

Forex atau *Foreign Exchange* adalah perdagangan mata uang suatu negara dengan mata uang negara lain (Suharto, 2012, p. 14). Tidak seperti pasar lainnya, pasar *forex* berjalan dalam rentang waktu 24 jam hari kerja. Trading *forex* sendiri dilaksanakan oleh bank, broker, *dealer*, institusi finansial. Trading *forex* juga dapat dilakukan melalui jaringan internet.

Dalam perdagangan ini, yang diperdagangkan selalu mata uang yang berpasangan misal *GBP/USD* yaitu perbandingan nilai mata uang *Poundsterling* terhadap *Dollar* Amerika sebagai dasar penilaian. Di dalam *forex* sendiri terdapat fluktuasi harga dimana terjadinya kenaikan dan penurunan harga. Dengan adanya fluktuasi harga maka seorang pelaku pasar dapat melakukan posisi membeli atau menjual. Untuk melakukan pembelian dan penjualan dibutuhkan keputusan yang tepat. Jika salah dalam mengambil keputusan maka pelaku pasar akan mengalami kerugian. Salah satu yang bisa dilakukan adalah menggunakan teknik *forecast*.

Pengertian peramalan menurut KBBI adalah melakukan prediksi tentang suatu peristiwa berdasarkan hasil perhitungan rasional atau ketepatan analisis data. Peramalan terhadap harga pasar *forex* sangat menguntungkan bagi pelaku pasar karena dapat memberikan informasi tentang harga yang akan datang. Menurut Penelitian Riza, Boko dan Diyah (2015) mengenai

perbandingan keakuratan *ARIMA* dan *EMA* didapatkan bahwa *ARIMA* lebih unggul dari *EMA* dalam meramalkan jangka pendek. Sedangkan untuk jangka panjang dapat menggunakan *EMA*. Dalam penelitian lainnya yang dilakukan Babu As (2015) ditemukan bahwa dalam penelitian sebelumnya membuktikan bahwa *Neural Network* lebih bagus daripada *Arima* dan *Fuzzy*. Tetapi, setelah dilakukan penelitian terhadap mata uang India, didapatkan bahwa model *ARIMA* lebih bagus. Kesimpulan, dapat dikatakan bahwa tidak semua model dapat menghasilkan hasil yang sama terhadap data lain, sehingga perlu diujicobakan pada data yang lain. Penelitian ini akan melakukan peramalan dengan menggunakan pasangan mata uang *GBP/USD* sebagai objek *test* untuk menguji apakah metode *ARIMA* mempunyai tingkat keberhasilan yang serupa dengan penelitian sebelumnya.

1.2 Rumusan Masalah

1. Bagaimana menerapkan *ARIMA* dalam peramalan harga *GBP/USD* dalam waktu per-bulan selama 6 bulan?

1.3 Tujuan dan Manfaat penelitian

Tujuan dan manfaat dari penelitian ini sebagai berikut:

1. Untuk menunjukkan proses peramalan dengan menggunakan *ARIMA*.
2. Memberikan manfaat pengetahuan tentang peramalan menggunakan *ARIMA*