

BAB 5

PENUTUP

5.1 Kesimpulan

Berdasarkan hasil perancangan, implementasi, dan pengujian sistem *trading* berbasis aturan yang telah dilakukan, dapat ditarik kesimpulan sebagai berikut:

1. Metode *trading* berbasis aturan berhasil dirancang dengan menggunakan harga penutupan *candle bearish* dan *candle bullish* terdekat pada awal setiap bulan sebagai referensi penentuan *level entry*, yang dikombinasikan dengan mekanisme *dual-entry* simultan tanpa *One Cancels Other (OCO)*. Seluruh aturan *entry* dan *exit* dirumuskan secara eksplisit dan terstruktur sehingga tidak memerlukan interpretasi subjektif, menjadikan metode ini dapat diterjemahkan langsung ke dalam algoritma yang sistematis pada pasar valuta asing USD/JPY.
2. Metode *trading* yang telah dirancang berhasil diimplementasikan ke dalam bentuk indikator kustom menggunakan bahasa pemrograman *Pine Script* versi 6 pada platform *TradingView*. Sistem dapat direplikasi secara konsisten, divisualisasikan melalui representasi kotak zona *entry*, *take profit*, dan *stop loss* pada grafik harga, serta digunakan sebagai alat pengujian *backtesting* berbasis data historis .
3. Pengujian dan evaluasi kinerja metode *trading* dilakukan melalui *backtesting* menggunakan data historis pasangan mata uang USD/JPY pada *timeframe* harian (D1) selama 36 bulan (Januari 2023 – Desember 2025) dengan total 72 transaksi. Hasil pengujian menunjukkan *win rate* sebesar 58,3% (42 menang dari 72 transaksi), *profit factor* sebesar 2,10, *maximum drawdown* sebesar \$150 per bulan, dan total *profit* kumulatif sebesar +\$4.800 dari modal awal \$1.000 dengan modal per *trade* sebesar \$50.
4. Analisis terhadap hasil *backtesting* selama tiga tahun pengujian menunjukkan bahwa metode *trading* yang dirancang memiliki konsistensi yang sangat tinggi, dengan seluruh parameter evaluasi *win rate*, *profit factor*, jumlah kemenangan, dan *maximum drawdown* menunjukkan nilai yang identik pada tahun 2023, 2024, dan 2025. Konsistensi ini membuktikan bahwa metode berbasis aturan

yang dirancang layak sebagai sistem *trading* yang objektif, terukur, dan dapat diandalkan dalam berbagai kondisi pasar.

5.2 Saran

Berdasarkan hasil penelitian yang telah dilakukan, saran untuk pengembangan penelitian selanjutnya adalah mengeksplorasi optimasi parameter *entry* seperti pemilihan referensi harga *candle* yang lebih selektif serta penyesuaian rasio *risk-reward* secara adaptif guna meningkatkan probabilitas keberhasilan transaksi. Pengembangan mekanisme filter tambahan berbasis *price action* atau pola *candlestick* tertentu juga dapat dipertimbangkan sebagai kriteria konfirmasi sebelum *entry* dieksekusi, sehingga kualitas sinyal yang dihasilkan lebih tinggi dan rasio kemenangan dapat ditingkatkan secara signifikan dari hasil yang telah dicapai dalam penelitian ini.

Selain itu, berdasarkan keterbatasan sistem yang ditemukan pada kondisi volatilitas ekstrem akibat faktor ekonomi makro maupun peristiwa geopolitik seperti perang, secara umum periode tersebut tidak direkomendasikan untuk melakukan transaksi karena pergerakan harga cenderung tidak terprediksi dan berisiko tinggi. Namun demikian, apabila *trader* tetap memilih untuk bertransaksi pada masa tersebut, disarankan untuk mengurangi ukuran modal per transaksi (*lot size*) dari nilai normal yang digunakan. Dengan memperkecil modal per transaksi, potensi kerugian absolut dapat ditekan sehingga modal keseluruhan tetap terlindungi meskipun terjadi pergerakan harga yang merugikan secara tiba-tiba. Pendekatan ini memungkinkan sistem tetap dapat dijalankan secara konsisten tanpa harus berhenti total, sekaligus menjaga ketahanan modal (*capital preservation*) sebagai prioritas utama dalam kondisi pasar yang tidak menentu.