

BAB V

KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan

Berdasarkan hasil perancangan, implementasi, dan pengujian *Expert Advisor* (EA) dengan strategi Martingale termodifikasi menggunakan indikator RSI dan Stochastic Oscillator pada *pair* GBP/AUD, dapat ditarik empat kesimpulan utama sebagai berikut:

1. Penelitian ini berhasil mengembangkan *Expert Advisor* yang mampu mengatasi kelemahan utama strategi Martingale konvensional, yaitu risiko *Margin Call*. Penerapan fitur pembatasan level maksimal (3-5 *step*) dan faktor penggandaan (*multiplier*) adaptif terbukti mampu mengamankan ekuitas akun. Hal ini dibuktikan dengan *drawdown* yang terjaga rendah selama pengujian *backtesting*, yakni hanya 3,25% pada skenario H1 dan 8,52% pada skenario H4, yang jauh di bawah batas toleransi risiko agresif.
2. Akurasi Sinyal dari Kombinasi Indikator RSI dan Stochastic Integrasi indikator RSI (periode 14) dan Stochastic Oscillator (5,3,3) efektif dalam menyaring kebisingan pasar (*market noise*) dan memberikan sinyal *entry* yang presisi. Pada pengujian Skenario 1 (H1), kombinasi ini menghasilkan tingkat kemenangan (*Win Rate*) sebesar 73,33% dengan *Profit Factor* mencapai 4,09. Hal ini menunjukkan bahwa filter teknikal yang digunakan mampu memvalidasi kondisi *oversold* dan *overbought* dengan akurat sebelum strategi Martingale dieksekusi.
3. Superioritas Timeframe H1 dibandingkan H4 Terdapat perbedaan kinerja yang signifikan antara penggunaan *timeframe* H1 dan H4. Skenario 1 (H1) terbukti lebih unggul dengan menghasilkan *Total Net Profit* sebesar \$1.132,22 dan efisiensi pemulihan modal (*Recovery Factor*) sebesar 3,81 pada pengujian *real-time*. Sebaliknya, Skenario 2 (H4) kurang responsif terhadap volatilitas jangka pendek, menghasilkan profit yang lebih rendah (\$806,62 pada *backtest*) serta risiko penahanan posisi (*floating*) yang lebih lama dan dalam.

4. Kinerja pada Akun Mikro dan Kondisi Real-Time Sistem terbukti berjalan stabil pada simulasi akun mikro XM dengan modal terbatas. Dalam pengujian *real-time* selama satu bulan, EA pada Skenario 1 mampu menghasilkan profit bersih tanpa mengalami satu pun transaksi rugi (*Gross Loss* 0). Kemampuan EA untuk beradaptasi dan tetap profitabel baik dalam data historis jangka panjang (2022-2024) maupun data pasar terkini (2025) menegaskan bahwa algoritma yang dibangun memiliki konsistensi yang baik.

5.2 Saran

Berdasarkan hasil penelitian dan keterbatasan yang ditemukan selama proses pengembangan, penulis mengajukan tiga saran untuk pengembangan selanjutnya dan penerapan praktis:

1. Meskipun strategi teknikal dan manajemen risiko Martingale termodifikasi sudah berjalan baik, EA ini belum memiliki kemampuan mendeteksi rilis berita ekonomi berdampak tinggi (*High Impact News*). Disarankan untuk penelitian selanjutnya agar menambahkan fitur *News Filter* yang terintegrasi dengan kalender ekonomi. Hal ini bertujuan untuk menghentikan aktivitas *trading* sementara saat terjadi volatilitas ekstrem akibat kebijakan bank sentral atau data inflasi, guna mencegah *drawdown* yang tidak terduga.
2. Penelitian ini hanya berfokus pada *pair* GBP/AUD yang memiliki karakteristik volatilitas tinggi. Disarankan bagi peneliti selanjutnya atau pengguna untuk melakukan uji coba dan optimasi parameter pada pasangan mata uang utama (*major pairs*) seperti EUR/USD atau komoditas seperti XAU/USD (Emas). Karakteristik pasar yang berbeda mungkin memerlukan penyesuaian pada periode RSI, level Stochastic, atau *multiplier* Martingale untuk mencapai hasil yang optimal.
3. Mengingat *Expert Advisor* ini menggunakan strategi Martingale yang memerlukan pemantauan posisi secara terus-menerus untuk melakukan *averaging* dan penutupan posisi otomatis, sangat disarankan bagi pengguna untuk menjalankan EA ini menggunakan *Virtual Private Server*

(VPS). Penggunaan VPS akan menjamin EA berjalan 24 jam sehari tanpa gangguan koneksi internet atau pemadaman listrik, yang sangat krusial untuk menjaga logika manajemen risiko tetap berfungsi sebagaimana mestinya.



THE
Character Building
UNIVERSITY