

BAB V

KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan

Berdasarkan hasil penelitian dan pembahasan mengenai implementasi Expert Advisor berbasis indikator Relative Strength Index (RSI) dan Moving Average (MA) dengan optimasi Dynamic Risk Management pada pair XAU/USD, maka dapat ditarik beberapa kesimpulan sebagai berikut:

1. Pengembangan Expert Advisor berhasil dilakukan dengan mengintegrasikan indikator RSI dan MA untuk mendeteksi peluang entry, serta dilengkapi mekanisme manajemen risiko adaptif. Hal ini membuat sistem mampu menyesuaikan ukuran lot dan proteksi terhadap volatilitas pasar XAU/USD.
2. Hasil backtesting pada timeframe H1 dan H4 menunjukkan bahwa optimasi parameter dapat meningkatkan stabilitas kinerja Expert Advisor. Meskipun masih mencatat kerugian, terdapat perbaikan pada metrik performa seperti profit factor, expected payoff, dan recovery factor dibandingkan sebelum optimasi.
3. Pengujian real-time memperlihatkan bahwa meskipun sistem belum mampu menghasilkan profit konsisten, terdapat perbaikan signifikan dalam pengendalian kerugian dan stabilitas performa. Profit factor dan expected payoff meningkat, meski net profit masih negatif, yang menunjukkan adanya potensi pengembangan lebih lanjut.
4. Evaluasi keseluruhan menunjukkan bahwa strategi trading otomatis dengan kombinasi RSI, MA, dan adaptive risk management cukup efektif dalam menekan risiko, namun masih belum optimal untuk menghasilkan profitabilitas berkelanjutan. Diperlukan penyempurnaan logika entry/exit, penambahan filter kondisi pasar, serta optimasi lanjutan agar dapat mencapai hasil yang lebih memuaskan.

5.2 Saran

Berdasarkan hasil penelitian yang telah diperoleh, penulis memberikan beberapa saran sebagai berikut:

1. Bagi trader praktis, penggunaan Expert Advisor ini dapat dijadikan alternatif untuk mengurangi pengaruh psikologis dalam trading. Namun, disarankan tetap menggunakan akun demo atau akun cent terlebih dahulu sebelum diterapkan pada akun riil dengan modal besar.
2. Bagi pengembang sistem, perlu dilakukan penelitian lanjutan dengan menambahkan indikator pendukung lain seperti Bollinger Bands, MACD, atau Stochastic untuk meningkatkan akurasi sinyal serta meminimalisasi sinyal palsu.
3. Bagi penelitian selanjutnya, disarankan untuk memperluas periode pengujian dengan data historis yang lebih panjang serta melakukan forward testing dalam jangka waktu lebih lama, sehingga dapat memberikan gambaran lebih komprehensif mengenai konsistensi kinerja EA pada berbagai kondisi pasar.
4. Bagi akademisi, penelitian ini dapat menjadi referensi awal dalam pengembangan Expert Advisor berbasis manajemen risiko adaptif. Perlu dilakukan kajian lanjutan mengenai penerapan machine learning atau artificial intelligence untuk meningkatkan kemampuan adaptasi strategi terhadap perubahan pasar yang dinamis.