

BAB V

KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan

Berdasarkan hasil penelitian, pengujian, dan analisis yang telah dilakukan terhadap Konstruksi *Expert Advisor* (EA) dengan Strategi *Fibonacci Money Management* Menggunakan Indikator *Ichimoku Cloud* pada Perdagangan *Crude Oil* (XTIUSD), maka dapat ditarik beberapa kesimpulan sebagai berikut:

1. Penelitian ini telah berhasil mengonstruksi dan mengimplementasikan sebuah *Expert Advisor* (EA) yang secara fungsional mampu mengintegrasikan sinyal perdagangan dari indikator *Ichimoku Cloud* dengan kerangka kerja manajemen risiko berbasis *Fibonacci Money Management*. Proses pengembangan yang sistematis menggunakan V-Model telah memastikan bahwa semua logika perdagangan, mulai dari identifikasi sinyal *entry* dan *exit* hingga kalkulasi ukuran lot dan penempatan *Stop Loss/Take Profit*, dapat berjalan secara otomatis pada platform MetaTrader 5 sesuai dengan rancangan yang telah ditetapkan.
2. Parameter optimal pada indikator *Ichimoku Cloud* dan pemilihan *timeframe* memiliki pengaruh yang sangat signifikan terhadap kinerja EA. Hasil pengujian menunjukkan bahwa Skenario 2 (H4) dengan parameter yang dioptimalkan untuk *time frame* yang lebih tinggi (Tenkan-sen: 7, Kijun-sen: 30, Senkou Span B: 50) menghasilkan kinerja yang lebih stabil dan profitabel secara konsisten dalam *backtesting* jangka panjang, dengan *Profit Factor* 1.72 dan *Maximum Drawdown* yang relatif terkendali. Sebaliknya, Skenario 1 (H1) meskipun menunjukkan profitabilitas dalam *backtesting*, memiliki profil risiko yang lebih tinggi (*Maximum Drawdown* 33.21%) dan terbukti tidak andal saat dihadapkan pada kondisi pasar aktual.
3. Terdapat diskrepansi yang tajam antara hasil *backtesting* dan *real-time testing*, yang menyoroti pentingnya validasi pada data *out-of-sample*.

Skenario 1 (H1) yang menunjukkan kinerja historis yang sangat baik, mengalami kegagalan signifikan dalam pengujian *real-time* dengan mencatatkan kerugian besar. Fenomena ini mengindikasikan adanya potensi *overfitting* (kurva suai) pada parameter yang digunakan, di mana strategi menjadi terlalu dioptimalkan untuk data masa lalu dan kehilangan kemampuannya untuk beradaptasi dengan dinamika pasar yang baru. Sebaliknya, Skenario 2 (H4) menunjukkan hasil positif dalam pengujian *real-time*, meskipun dengan jumlah sampel yang sangat terbatas.

4. Performa *Expert Advisor* yang dikonstruksi menunjukkan ketergantungan yang kuat pada kondisi pasar trading *bullish*. Analisis hasil *backtesting* pada kedua skenario menunjukkan bahwa mayoritas besar, bahkan seluruhnya, transaksi yang dieksekusi adalah posisi beli (*long trades*). Hal ini mengindikasikan bahwa logika strategi yang dibangun belum cukup mumpuni untuk mengidentifikasi dan memanfaatkan peluang profit pada kondisi pasar *bearish* (tren turun) atau *sideways* (konsolidasi), yang menjadi salah satu kelemahan utama dari sistem yang dikembangkan.

5.2 Saran

Berdasarkan kesimpulan yang telah diuraikan serta keterbatasan yang ditemukan selama proses penelitian, berikut adalah beberapa saran yang dapat dijadikan sebagai bahan pertimbangan untuk pengembangan penelitian selanjutnya maupun untuk implementasi praktis:

1. Disarankan bagi peneliti selanjutnya untuk melakukan periode pengujian *real-time* (*forward testing*) yang jauh lebih panjang, idealnya antara 3 hingga 6 bulan. Periode pengujian selama satu bulan dengan jumlah transaksi yang sangat sedikit (khususnya pada Skenario 2 yang hanya menghasilkan satu transaksi) secara statistik tidak cukup signifikan untuk memvalidasi ketahanan dan profitabilitas jangka panjang sebuah strategi. Pengujian yang lebih lama akan memberikan sampel data yang lebih representatif, mencakup berbagai kondisi dan volatilitas pasar yang

berbeda, sehingga evaluasi terhadap kinerja EA dapat dilakukan dengan lebih objektif dan terhindar dari kesimpulan yang bias akibat faktor kebetulan atau kondisi pasar yang ideal sesaat.

2. Untuk meningkatkan ketahanan dan kemampuan adaptasi EA, disarankan untuk melakukan pengembangan lebih lanjut dengan menambahkan logika strategi yang mampu mengidentifikasi dan mengeksekusi perdagangan dalam berbagai kondisi pasar, tidak hanya terbatas pada tren *bullish*. Ini dapat diimplementasikan dengan cara merancang aturan spesifik untuk posisi jual (*short trades*) berdasarkan sinyal *bearish* dari *Ichimoku Cloud* (misalnya, perpotongan Tenkan-sen dan Kijun-sen di bawah Kumo) dan menambahkan filter atau indikator lain seperti *Average Directional Index* (ADX) untuk mendeteksi kondisi pasar *sideways* atau konsolidasi, di mana EA dapat diatur untuk tidak melakukan perdagangan guna menghindari sinyal palsu dan kerugian yang tidak perlu.
3. Disarankan untuk melakukan eksplorasi terhadap implementasi parameter yang bersifat dinamis atau adaptif. Parameter indikator yang bersifat tetap (statis) seperti yang digunakan dalam penelitian ini memiliki kelemahan karena tidak dapat menyesuaikan diri dengan perubahan volatilitas pasar yang terjadi dari waktu ke waktu. Penelitian selanjutnya dapat menguji penggunaan *Average True Range* (ATR) tidak hanya untuk *trailing stop*, tetapi juga untuk secara dinamis menyesuaikan periode pada indikator *Ichimoku* atau level *Stop Loss* dan *Take Profit* Fibonacci. Selain itu, penggabungan dengan teknik *machine learning* sederhana untuk optimasi parameter secara berkala dapat menjadi sebuah inovasi yang berpotensi meningkatkan kinerja dan relevansi EA dalam jangka panjang.