

## BAB V

### KESIMPULAN

#### 5.1 Kesimpulan

##### 1. Pengembangan Expert Advisor (EA)

Pengembangan Expert Advisor (EA) dengan mengombinasikan indikator Relative Strength Index (RSI) dan *Smoothed Moving Average (SMMA)* telah terbukti mampu menghasilkan kinerja yang positif. Integrasi kedua indikator tersebut memungkinkan EA untuk mengidentifikasi sinyal transaksi secara otomatis dan konsisten pada instrumen indeks US100, sehingga sistem dapat membantu pengambilan keputusan trading tanpa keterlibatan manual secara langsung.

##### 2. Pengaruh Parameter terhadap Kinerja EA

Kinerja EA sangat dipengaruhi oleh pemilihan parameter indikator dan rentang waktu pengujian. Pada timeframe M30, strategi menunjukkan karakteristik yang lebih agresif dengan tingkat profitabilitas yang lebih tinggi, sedangkan pada timeframe H1 strategi cenderung lebih stabil dengan pengendalian risiko yang lebih terjaga. Hasil pengujian menunjukkan bahwa penyesuaian periode RSI dan SMMA berperan penting dalam meningkatkan kualitas sinyal transaksi, memperbaiki nilai *Expected Payoff*, serta menjaga keseimbangan antara potensi keuntungan dan risiko yang ditanggung.

##### 3. Kinerja EA pada Akun Standar FXTM

Pengujian yang dilakukan melalui platform MetaTrader 5 pada akun standar FXTM menunjukkan bahwa EA mampu beroperasi dengan baik pada kedua timeframe yang diuji. Nilai *Profit Factor* dan *Expected Payoff* yang berada di atas batas minimum, serta *Maximum Drawdown* yang sangat rendah, membuktikan bahwa strategi memiliki tingkat profitabilitas dan manajemen risiko

yang baik. Selain itu, nilai Sharpe Ratio yang tinggi pada timeframe M30 menunjukkan efisiensi imbal hasil terhadap risiko, sehingga dapat disimpulkan bahwa EA bersifat stabil dan mampu memberikan performa yang konsisten pada kondisi.

## **5.2 Saran**

### **1. Pengembangan Sistem dan Parameter Lanjutan**

Untuk meningkatkan kinerja Expert Advisor (EA) di masa mendatang, disarankan agar dilakukan penambahan indikator pendukung seperti *Average True Range (ATR)* atau indikator berbasis volume guna mengukur tingkat volatilitas pasar. Selain itu, optimasi parameter RSI dan SMMA dapat diperdalam dengan penyesuaian yang lebih rinci agar EA mampu beradaptasi secara lebih optimal terhadap perubahan karakteristik pasar indeks US100.

### **2. Pengujian pada Berbagai Kondisi Pasar dan Time Frame**

Berdasarkan hasil penelitian yang menunjukkan adanya perbedaan kinerja antara *timeframe* M30 dan H1, penelitian selanjutnya disarankan untuk melakukan pengujian pada kondisi pasar yang lebih bervariasi, seperti fase *sideways*, tren naik yang kuat, maupun tren turun yang kuat. Penambahan timeframe lain juga perlu dipertimbangkan guna menemukan kombinasi terbaik antara tingkat keuntungan dan stabilitas risiko.

### **3. Perluasan Instrumen dan Lingkungan Trading**

Agar metode yang dikembangkan tidak hanya terbatas pada indeks US100, disarankan untuk melakukan pengujian lanjutan pada indeks lain atau instrumen keuangan yang memiliki karakteristik volatilitas berbeda. Selain itu, pengujian pada berbagai jenis akun dan broker juga perlu dilakukan untuk memastikan bahwa performa EA tetap konsisten meskipun terdapat perbedaan kondisi trading.

#### **4. Evaluasi Keamanan dan Manajemen Risiko**

Meskipun hasil pengujian menunjukkan bahwa nilai drawdown, khususnya pada *timeframe* M30, berada pada tingkat yang sangat rendah, pengembangan sistem manajemen risiko tetap perlu dilakukan. Penerapan fitur seperti *trailing stop*, *break-even*, serta penyesuaian ukuran lot berbasis ekuitas dapat meningkatkan perlindungan modal, terutama pada periode pasar dengan volatilitas tinggi.

#### **5. Implementasi dan Pemantauan Berkelanjutan**

Penerapan EA pada akun real memerlukan pemantauan secara berkala untuk memastikan strategi tetap relevan terhadap perubahan kondisi pasar. Oleh karena itu, forward testing dan pembaruan parameter secara rutin sangat disarankan, mengingat pergerakan indeks tidak selalu mengikuti pola historis yang sama

