BAB V
KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan

Berdasarkan hasil penelitian yang telah dilaksanakan melalui dua fase pengujian, yaitu *backtesting* dan *forward testing*, terhadap sistem *trading* otomatis berbasis *Order Block Detection* pada pasangan mata uang XAU/USD Micro di platform MetaTrader 5 melalui akun demo broker PT Monex Investindo Futures (MIFX), dapat ditarik beberapa kesimpulan sebagai berikut.

1. penelitian ini berhasil merancang dan mengimplementasikan sistem trading otomatis dalam bentuk *Expert Advisor (EA)* yang menggunakan strategi *Order Block Detection* pada pasangan XAU/USD *Micro* menggunakan bahasa *pemrograman* MQL5. Sistem yang dikembangkan berhasil menjalankan secara otomatis seluruh proses identifikasi zona *Order Block*, *Limit Order*, *Stop Loss* dan *Take Profi*t, serta pengelolaan ukuran lot secara adaptif berdasarkan risiko per transaksi, tanpa memerlukan intervensi manual dari *trader*. Keberhasilan implementasi ini membuktikan bahwa konsep *Smart Money Concept*, khususnya strategi *Order Block Detection* yang selama ini banyak diterapkan secara manual oleh *trader*, dapat diimplementasikan secara penuh ke dalam *algoritma* atau bahasa komputer yang bekerja secara otomatis dan konsisten.
2. hasil pengujian pada kedua fase menunjukkan bahwa sistem mampu menghasilkan *performance metrics* yang terukur dan memenuhi standar keberhasilan yang ditetapkan dalam penelitian ini. Pada fase *backtesting*, sistem menghasilkan *profit factor, win rate,* dan *roi* yang melampaui seluruh kriteria yang ditetapkan, sementara pada fase *forward testing* sistem tetap mampu menghasilkan keuntungan positif dalam kondisi pasar yang sesungguhnya, meskipun terjadi penurunan pada sebagian metrik dibandingkan hasil *backtesting*. Penerapan *Risk:Reward Ratio* yang konsisten pada kedua fase memastikan rata-rata keuntungan per transaksi menang tetap jauh lebih besar dibandingkan rata-rata kerugian per transaksi kalah, sehingga sistem tetap beroperasi secara *profitabel* dalam kedua kondisi pengujian tersebut..
3. perbandingan antara hasil *backtesting* dan *forward testing* menunjukkan bahwa sistem memiliki konsistensi performa yang baik meskipun diuji pada *timeframe*, periode, dan kondisi pasar yang berbeda. Penurunan performa yang terjadi pada fase *forward testing* tergolong wajar dan telah

diantisipasi, yang disebabkan oleh perbedaan *timeframe* yang digunakan, perbedaan kondisi pasar antara kedua periode pengujian, serta sifat alami dari sistem *trading algoritmik* yang cenderung mengalami penurunan performa saat dihadapkan pada kondisi pasar yang baru. Yang paling penting, sistem tetap menghasilkan keuntungan positif pada kedua fase pengujian dengan kondisi yang sangat berbeda, yang menjadi bukti nyata bahwa sistem trading otomatis berbasis *Order Block Detection* memiliki keunggulan yang bersifat struktural dan konsisten, bukan sekadar keberuntungan pada kondisi historis tertentu, serta terbukti fleksibel untuk beroperasi pada berbagai timeframe tanpa kehilangan profitabilitasnya.

Secara keseluruhan, penelitian ini berhasil membuktikan bahwa implementasi sistem trading otomatis berbasis *Order Block Detection* pada pasangan XAU/USD Micro adalah layak dan memiliki potensi *profitabilitas* yang nyata, sebagaimana dibuktikan oleh kemampuan sistem untuk menghasilkan keuntungan secara konsisten pada kedua fase pengujian yang telah dilaksanakan.

5.2 Saran

Berdasarkan hasil penelitian, analisis, dan kesimpulan yang telah dipaparkan, terdapat beberapa saran yang dapat dijadikan bahan pertimbangan bagi penelitian selanjutnya maupun bagi praktisi yang ingin mengembangkan sistem *trading* otomatis serupa.

1. penelitian selanjutnya disarankan untuk menguji sistem pada beberapa instrumen lain selain XAU/USD, seperti pasangan mata uang mayor (EUR/USD, GBP/USD) atau komoditas lain (XAG/USD), untuk mengevaluasi apakah keunggulan strategi *Order Block Detection* yang ditemukan dalam penelitian ini bersifat spesifik pada XAU/USD atau dapat digeneralisasi pada instrumen lain.
2. disarankan untuk mengeksplorasi penggunaan *multi-timeframe* analysis dalam *algoritma Order Block Detection*, di mana sistem mengidentifikasi zona *Order Block* pada *timeframe* yang lebih besar (H6 atau H4) namun melakukan eksekusi pada *timeframe* yang lebih kecil (H2 atau H1). Pendekatan ini berpotensi menghasilkan sinyal dengan kualitas yang lebih tinggi sekaligus frekuensi yang lebih banyak.
3. bagi trader atau peneliti yang ingin menerapkan sistem serupa, sangat disarankan untuk terlebih dahulu melakukan pengujian yang menyeluruh pada akun *demo* dalam jangka waktu yang cukup panjang sebelum beralih ke akun live dengan dana riil. Hasil penelitian ini menunjukkan bahwa performa sistem dapat berubah secara signifikan tergantung kondisi pasar, sehingga pemahaman mendalam tentang karakteristik sistem dalam

berbagai kondisi pasar sangat penting sebelum mengambil risiko finansial yang nyata.

Pada intinya, pengembangan sebuah sistem *trading* otomatis yang andal dan konsisten bukanlah sesuatu yang dapat dicapai dalam satu iterasi penelitian saja, melainkan merupakan proses yang berkelanjutan yang memerlukan pengujian, evaluasi, dan penyempurnaan secara terus-menerus. Penelitian ini telah memberikan fondasi awal yang cukup kuat tentang kelayakan strategi *Order Block Detection* sebagai basis sistem *trading otomatis* pada instrumen XAU/USD, dan diharapkan hasil serta temuan yang diperoleh dapat menjadi pijakan yang berguna bagi peneliti berikutnya untuk melanjutkan pengembangan ke tahap yang lebih lanjut dan lebih optimal. Dengan semakin berkembangnya teknologi *finansial* dan semakin luasnya akses terhadap platform *trading algoritmik* seperti MetaTrader 5, peluang untuk mengembangkan sistem *trading otomatis* yang semakin canggih dan adaptif semakin terbuka lebar, dan penelitian-penelitian seperti ini merupakan kontribusi yang penting dalam membangun ekosistem pengetahuan yang lebih kaya di bidang *trading algoritmik* berbasis *Smart Money Concept* di Indonesia.