DAFTAR ISI

Halaman

LEMBAR PERSETUJUAN DAN PENGESAHAN.....i
LEMBAR PERSETUJUAN PEMBIMBING.....ii
RIWAYAT HIDUP..... iii
HALAMAN PERNYATAAN ORISINALITAS.....iv
HALAMAN PERSETUJUAN PUBLIKASI TUGAS AKHIR SKRIPSI..... v
ABSTRAK..... vi
ABSTRACT.....vii
KATA PENGANTAR..... viii
DAFTAR ISI..... x
DAFTAR TABEL.....xiii
DAFTAR GAMBAR..... xiv
DAFTAR LAMPIRAN..... xv

BAB I PENDAHULUAN.....1
1.1 Latar Belakang Masalah.....1
1.2 Identifikasi Masalah..... 11
1.3 Pembatasan Masalah..... 11
1.4 Rumusan Masalah..... 11
1.5 Tujuan Penelitian.....12
1.6 Manfaat Penelitian..... 12

BAB II KAJIAN PUSTAKA..... 14
2.1 Kerangka Teoritis..... 14
2.1.1 Financial Technology (Fintech)..... 14
2.1.2 Trading..... 17
2.1.3 Trading otomatis..... 21
2.1.4 Pasar Forex XAU/USD.....23
2.1.5 Analisis Teknikal.....25
2.1.6 Order Block Detection..... 26
2.1.7 Meta Trader.....29
2.1.8 Broker MIFX.....30
2.2 Penelitian Terdahulu.....32
2.3 Kerangka Berpikir.....40

BAB III METODE PENELITIAN..... 41
3.1 Lokasi Penelitian.....41

3.2 Definisi Operasional....43
3.2.1 Sistem Trading Otomatis....43
3.2.2 Order Block Detection....44
3.2.3 XAU/USD Micro....44
3.2.4 Akun Demo....45
3.2.5 Broker MIFX....45
3.2.6 Platform MetaTrader 5 (MT5)....45
3.2.7 Expert Advisor (EA)....46
3.3 Teknik Pengumpulan Data....46
3.3.1 Studi Literatur (Literature Review)....46
3.3.2 Studi Dokumentasi....46
3.3.3 Data Historis Pasar (Historical Market Data)....47
3.3.4 Data Eksekusi Trading (Trade Execution Data)....47
3.4 Data dan Sumber Data....47
3.4.1 Jenis Data....47
3.4.2 Sumber Data....48
3.5 Teknik Analisis Data....48
3.5.1 Analisis Data Backtesting....48
3.5.2 Analisis Data Forward Testing....49
3.6 Model Pengembangan Sistem....49
3.6.1 Pengumpulan Kebutuhan dan Analisis....51
3.6.2 Desain Prototype....51
3.6.3 Implementasi Prototype....52
3.6.4 Evaluasi Prototype....52
3.6.5 Finalisasi dan Deployment Sistem....53
3.6.6 Alur Penelitian (Flowchart)....54
3.7 Kriteria Keberhasilan Sistem....54
3.7.1 Tingkat Keuntungan Tahunan (Return on Investment/ROI)....55
3.7.2 Tingkat Penurunan Maksimal Modal (Maximum Drawdown)....55
3.7.3 Jumlah Transaksi Minimum (Sample Size)....55
3.7.4 Rasio Efisiensi Keuntungan terhadap Kerugian (Profit Factor)....56
3.7.5 Rasio Efisiensi Risiko (Calmar Ratio)....56

BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN....58
4.1 Hasil Pengembangan Sistem Trading Otomatis....58
4.1.1 Gambaran Umum dan Implementasi Sistem....58
4.1.2 Mekanisme Kerja Sistem Order Block Detection....59
4.1.3 Hasil Backtesting....61

4.1.4 Hasil Forward Testing..... 65
4.2 Analisis Perbandingan dan Evaluasi Hasil Pengujian.....71
4.2.1 Evaluasi Kriteria Keberhasilan Sistem.....72
4.2.2 Analisis Konsistensi Profitabilitas..... 73
4.2.3 Analisis Penurunan Performa dan Faktor Penyebabnya..... 75
4.2.4 Analisis Manajemen Risiko pada Kedua Fase Pengujian..... 76
4.3 Analisis Sistem Trading Otomatis pada Timeframe H6 dan H2..... 77
4.3.1 Gambaran Umum Perbedaan Timeframe.....77
4.3.2 Karakteristik Sinyal Order Block pada Timeframe H6.....77
4.3.3 Karakteristik Sinyal Order Block pada Timeframe H2.....78
4.3.4 Implikasi Perbedaan Timeframe terhadap Performa Sistem.....79

BAB V KESIMPULAN DAN SARAN..... 81
5.1 Kesimpulan..... 81
5.2 Saran.....82
DAFTAR PUSTAKA.....84
LAMPIRAN.....87