

**Kajian Kinerja Strategi Trading Menggunakan Data Backtest  
Forex**



Disusun oleh:

Najma Aura Dias Prameswari

A11.2022.14532

A11.4504

**PROGRAM STUDI TEKNIK INFORMATIKA  
FAKULTAS ILMU KOMPUTER  
UNIVERSITAS DIAN NUSWANTORO SEMARANG  
2024**

## **Deskripsi Singkat**

Dokumen ini bertujuan untuk menyusun proposal verifikasi hasil trading yang tercatat dari seorang trader. Proposal ini akan mencakup rencana analisis untuk memastikan apakah strategi trading yang digunakan benar-benar menghasilkan profit secara konsisten atau tidak. Analisis mencakup perhitungan profit, jumlah pips, probabilitas kemenangan, dan metrik risiko-keuntungan untuk mengukur keakuratan hasil trading.

## **MASALAH dan Tujuan yang ingin dicapai**

**Masalah :** Klaim profit dan kinerja dari seorang trader sering kali diragukan, terutama jika metriknya terlihat sangat menguntungkan. Dengan menggunakan dataset backtest, akan dilakukan pengecekan apakah klaim profit, pips dan metric lainnya valid atau tidak.

**Tujuan :** Melakukan verifikasi terhadap metric kinerja yang tercatat dalam dataset, seperti total profit, rata – rata profit per trade, total pips dan rasio risiko – keuntungan, untuk mengetahui apakah hasil trading yang dilaporkan benar atau berlebihan.

## **ALUR/TAHAPAN/KERANGKA EKSPERIMEN**

1. Data preprocessing : Membersihkan dan mempersiapkan dataset, termasuk memeriksa apakah ada data yang hilang atau tidak konsisten
2. Perhitungan metric : Menghitung kembali metric yang ada di dalam dataset, seperti total profit, rata – rata profit per trade, total pips, rata – rata pips per trade, rasio risiko – keuntungan, holding period rata – rata
3. Perbandingan hasil : Membandingkan hasil perhitungan dari dataset dengan klaim yang terdapat di laporan milik trader, apakah hasilnya cocok atau tidak.
4. Evaluasi kesimpulan : Menginterpretasikan hasil perhitungan dan membersihkan kesimpulan apakah klaim tersebut sesuai dengan data yang ada

## **PENJELASAN DATASET**

### **1. Sumber Data:**

dataset ini merupakan data privat yang diperoleh langsung dari seorang trader yang melakukan trading forex pada pasangan mata uang XAUUSD. Data ini dihasilkan sebagai bagian dari catatan pribadi trader untuk melacak performa strateginya. Penggunaan data ini hanya untuk keperluan analisis internal guna memverifikasi klaim profitabilitas dan efektivitas strategi trading yang diterapkan.

### **2. Penjelasan Atribut:**

**Pair :** pasangan mata uang yang diperdagangkan, yaitu mata uang XAUUSD.

**Action :** tindakan yang diambil oleh trader, yaitu buy atau sell, yang menunjukkan posisi yang dibuka pada harga tertentu.

**Tanggal entry dan tanggal exit :** tanggal dan waktu kapan setiap transaksi dimulai (entry) dan diakhiri(exit).

**Entry :** harga masuk saat trader membuka posisi.

**TP (take profit) dan SL (stop loss) :** parameter manajemen risiko yang ditetapkan oleh trader untuk menentukan batas keuntungan (tp) dan batas kerugian (sl).

Keterangan : informasi tambahan yang menunjukkan status transaksi, seperti apakah target profit tercapai atau posisi ditutup karena stop loss.

Karena dataset ini berisi data privat yang berisikan strategi dan hasil trading secara spesifik dari trader, maka penggunaan data terbatas pada keperluan analisis internal dan verifikasi. Informasi ini tidak akan dibagikan atau dipublikasikan tanpa izin eksplisit dari trader yang bersangkutan.

**Timeline proyek :**

1. Persiapan data :  
Mengumpulkan dan memahami dataset yang diberikan oleh trader, mengonfirmasi izin dan memastikan privasi data
2. Preprocessing dan normalisasi data :  
Membersihkan data, melakukan normalisasi atau skala data sesuai kebutuhan analisis.
3. Analisis data :  
Menghitung kembali metric penting seperti total profit, rata – rata profit per trade, total pips, rata – rata pips per trade dan rasio risiko – keuntungan, memeriksa keakuratan metric yang ada didataset dengan klaim yang ada.
4. Validasi dan perbandingan hasil :  
Membandingkan hasil perhitungan dengan metric klaim profit dari trader, melakukan analisis statistic (jika perlu) untuk mengukur keandalan klaim.
5. Penyusunan laporan dan kesimpulan :  
Menyusun laporan hasil analisis dan verifikasi klaim, menyimpulkan apakah data mendukung klaim profit trader atau tidak.