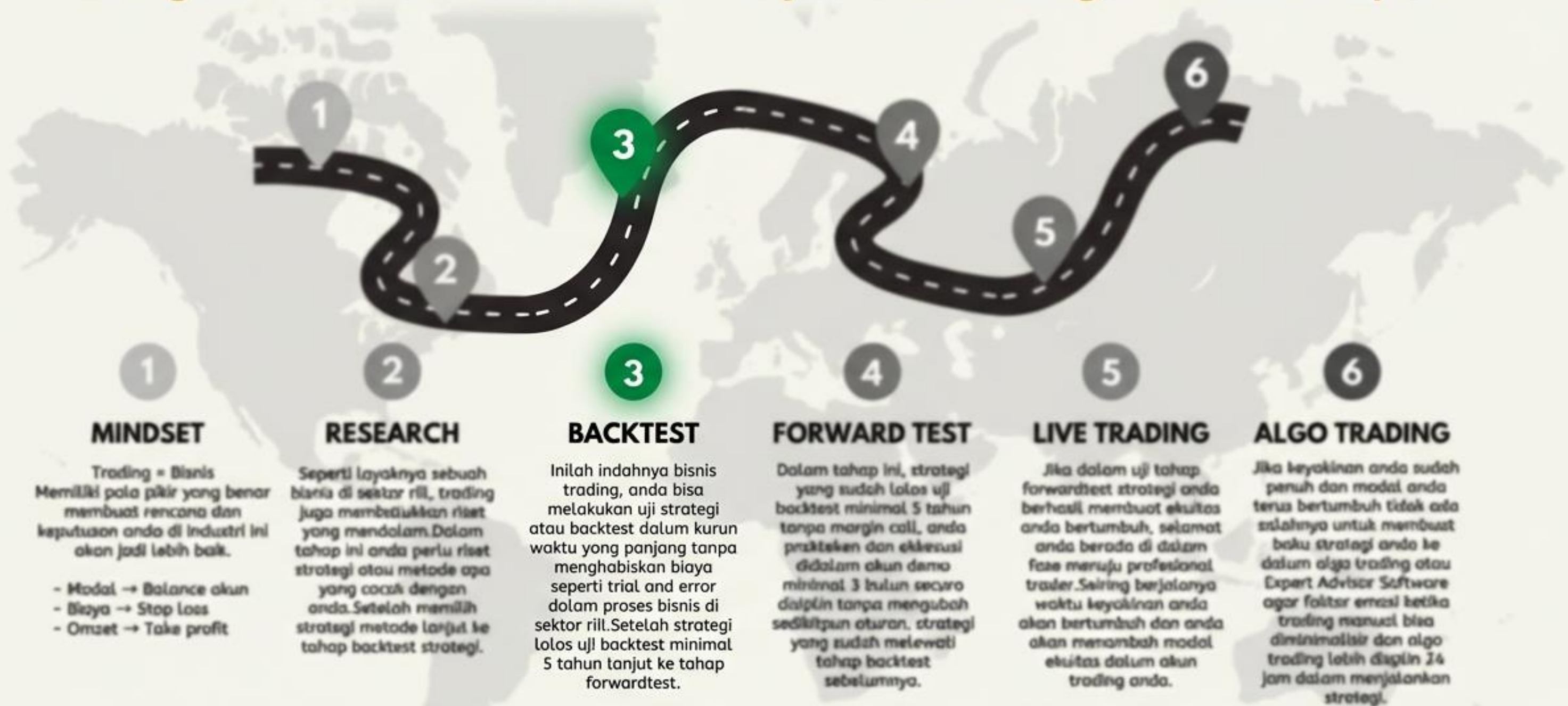


Langkah 3: Backtest — Mesin Waktu Trader

Mengubah Data Masa Lalu Menjadi Keuntungan Masa Depan



Posisi Kita Saat Ini: Anda telah menyelesaikan Mindset (Langkah 1) dan Riset (Langkah 2). Sekarang saatnya validasi.

Tujuan: Menguji hipotesis strategi tanpa risiko finansial.



Dilema Bisnis Sektor Riil

- Dalam bisnis konvensional, validasi ide membutuhkan modal nyata.
- Sewa tempat, stok barang, gaji karyawan = Biaya Trial & Error yang besar.
- Jika rencana gagal, uang hangus. Risiko kegagalan dibayar dengan kerugian finansial.



Keunggulan Unik Bisnis Trading

- Inilah indahnya bisnis trading: Kita memiliki 'Laboratorium Waktu'.
- Anda bisa melakukan uji strategi dalam kurun waktu yang panjang tanpa mengeluarkan biaya sepeser pun.
- Menghindari biaya trial and error yang menghancurkan modal seperti di sektor riil.

Definisi Backtest



INPUT:
Aturan Entry & Exit



PROSES:
Simulasi Data Historis



OUTPUT:
Data Performa Objektif

Proses simulasi eksekusi strategi menggunakan data historis pasar (chart masa lalu).

Menguji metode yang telah Anda pilih di tahap Riset (Langkah 2) seolah-olah Anda sedang trading secara live saat itu.

Syarat Mutlak 1: Durasi Minimal 5 Tahun

Mengapa harus 5 tahun? Karena pasar terus berubah. Strategi Anda harus teruji mampu bertahan di segala cuaca ekonomi: Bullish, Bearish, dan Konsolidasi. Uji sampel pendek (1 tahun) adalah keberuntungan. Uji sampel panjang (5 tahun) adalah statistik.



Syarat Mutlak 2: Zero Margin Call

Kriteria Kelulusan: Akun tidak boleh habis (MC) di titik mana pun selama simulasi 5 tahun.

Margin Call = Game Over. Dalam bisnis trading, jika modal habis, Anda keluar dari permainan.

Profit setinggi apapun tidak valid jika di tengah jalan akun mengalami Margin Call.



Bertahan Dahulu, Profit Kemudian

Backtest adalah stress-test untuk strategi Anda.

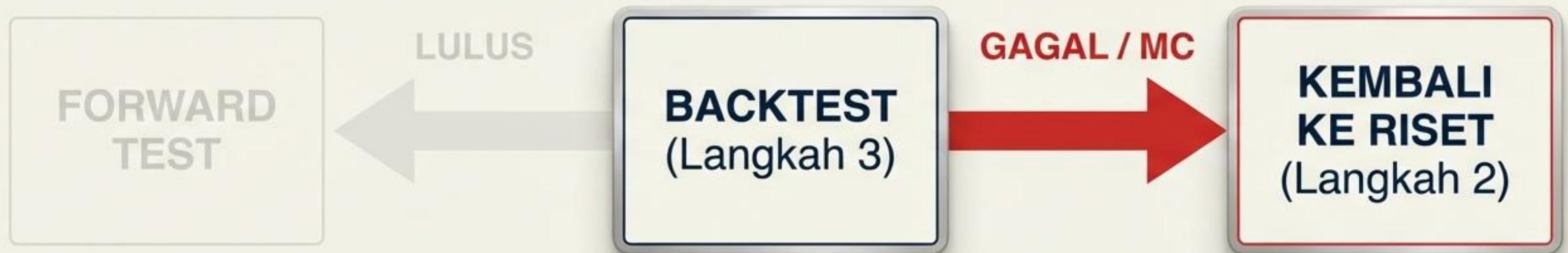
Kita mencari strategi yang “Anti-Rapuh” (Anti-Fragile).

Jika dalam simulasi 5 tahun strategi Anda membakar akun, itu adalah tanda peringatan dini untuk menyelamatkan uang asli Anda di masa depan.



Jika Gagal, Kembali ke Riset

Gagal memenuhi syarat 5 tahun atau terkena Margin Call? Jangan memaksa lanjut. Kembali ke Langkah 2 (Research). Evaluasi ulang indikator, timeframe, atau manajemen risiko Anda. Lebih baik 'berdarah' di tahap Backtest (simulasi) daripada 'berdarah' di Live Trading.

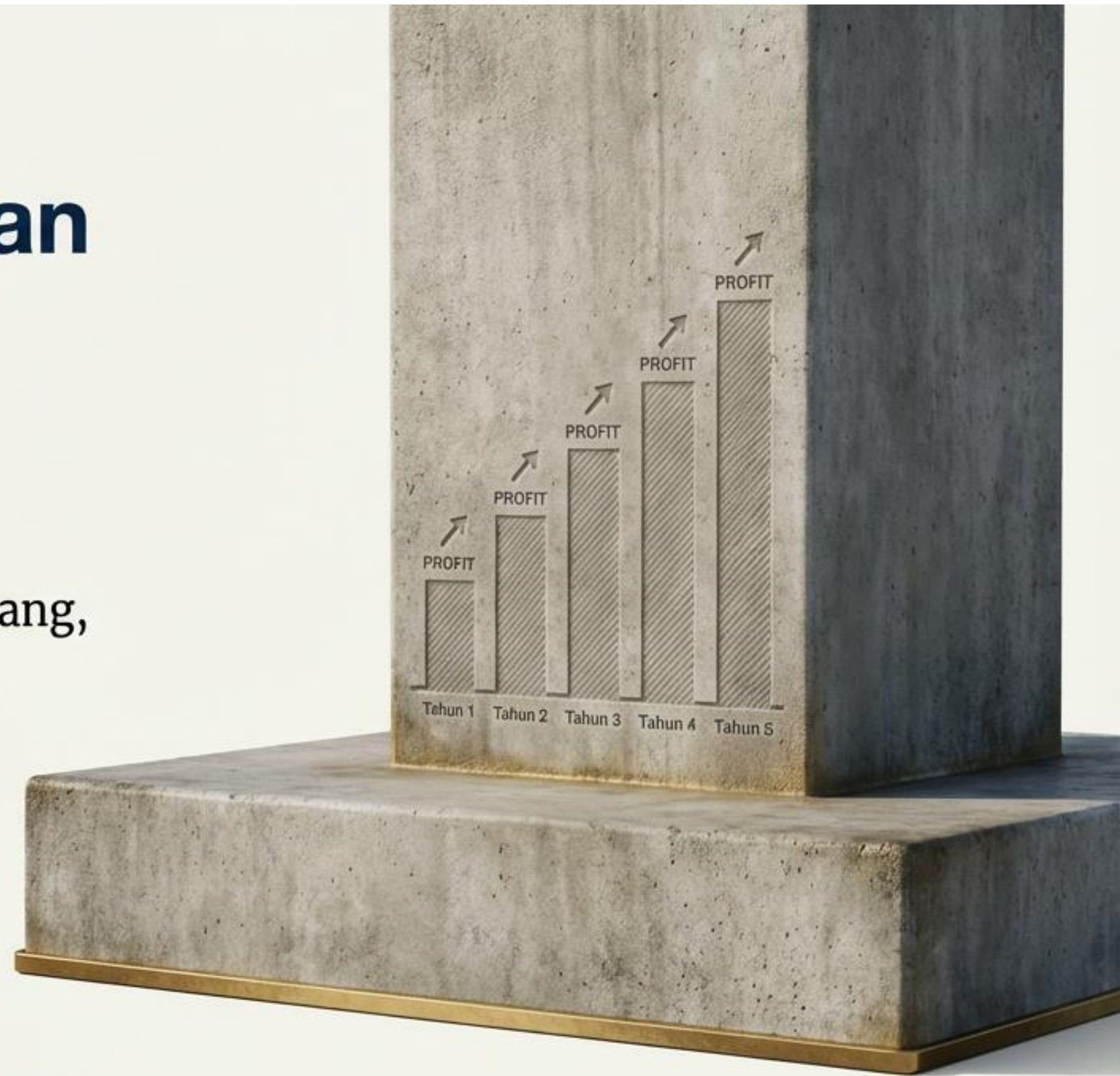


Membangun Keyakinan (Conviction)

Data historis membangun mental baja.

Saat Anda melihat strategi Anda konsisten menghasilkan profit selama 5 tahun ke belakang, keraguan Anda akan hilang.

Anda tidak lagi menebak-nebak.
Anda mengeksekusi probabilitas.



Checklist Kelulusan Tahap Backtest



1. Data historis mencakup minimal 5 tahun.



2. Strategi menghasilkan profit (Net Positive).



3. Tidak pernah terkena Margin Call sekalipun.

Jika ketiga kotak ini tercentang, Anda berhak melaju ke tahap selanjutnya.

Tiket Menuju Forward Test



Lulus Backtest artinya strategi Anda valid secara historis.

Langkah Selanjutnya (Step 4): **Forward Test.**

Menguji strategi di pasar yang berjalan (**Real-time**) menggunakan akun demo.

Ingat: Jangan loncat ke akun real sebelum lulus **Forward Test!**

Percayakan Pada Data, Bukan Emosi



Trading profesional adalah bisnis probabilitas.

Jadikan Backtest sebagai fondasi bisnis Anda.

Sabar dalam pengujian = Tenang dalam eksekusi.

Lakukan pekerjaan rumah Anda sekarang, nikmati hasilnya nanti.