

MODUL SISTEM BACKTEST & PENILAIAN PRESTASI

✓ OBJEKTIF PEMBELAJARAN:

- Memahami kepentingan backtesting dalam membina keyakinan teknik
 - Belajar cara menjalankan backtest secara manual dan sistematik
 - Menilai prestasi trading dan menyesuaikan strategi berdasarkan data sebenar
-

🔄 1. APA ITU BACKTESTING?

Backtesting ialah proses menguji sesuatu strategi menggunakan data pergerakan harga silam. Tujuannya adalah untuk:

- Lihat keberkesanan strategi
 - Kenal pasti win rate & risk:reward
 - Kenal pasti bila strategi gagal atau berjaya
-

✂ 2. CARA BUAT BACKTEST MANUAL

1. Pilih 1 pair dan 1 teknik (cth: EURUSD + SNR + Engulfing)
 2. Gunakan chart MT4 / TradingView dan rewind ke data lama
 3. Lihat candle satu demi satu dan tandakan setup entry
 4. Catatkan SL, TP, dan keputusan trade (Win/Loss)
 5. Ulang sekurang-kurangnya 50–100 trade
-

📊 3. FORMAT PENILAIAN PRESTASI

Gunakan jadual/log untuk rekod seperti:

- Tarikh
 - Pair
 - Timeframe
 - Entry & Exit
 - SL / TP (pips)
 - Risiko (USD)
 - Hasil (Win/Loss)
 - Catatan (emosi, kesilapan, nota teknik)
-



4. ANALISIS KEPUTUSAN BACKTEST

- **Win Rate:** % daripada entry yang menang
 - **Average R:R:** Purata risk:reward sebenar
 - **Drawdown:** Berapa kerugian maksimum berturut-turut
 - **Kesilapan berulang:** Adakah selalu masuk terlalu awal, SL terlalu dekat, dll.
-



5. PENYESUAIAN STRATEGI

Gunakan hasil backtest untuk:

- Ubah lokasi SL/TP jika perlu
 - Buang setup yang gagal terlalu kerap
 - Tambah filter untuk tapis entry berisiko
-



6. LATIHAN PELAJAR

Tugasan:

1. Buat 50 backtest entry menggunakan 1 teknik yang dipilih
2. Isikan ke dalam template log prestasi
3. Bina laporan: berapa % win rate, purata R:R, dan apa perlu diperbaiki

Soalan:

- Apakah kelemahan teknik anda berdasarkan backtest?
 - Adakah hasil anda konsisten?
 - Apakah tindakan anda untuk tambah baik strategi?
-



7. PENUTUP MODUL

Backtesting bukan sekadar untuk "bukti teknik jadi", tapi untuk membina keyakinan dan konsistensi. Trader yang berjaya **percaya pada data, bukan rasa hati**.