

## DLG\_system\_USDJPY\_M5(MT4)の概要（バックテスト結果に基づく紹介）

### 【設定概要】

- ①通貨：USDJPY
- ②ロット：0.10
- ③バックテスト期間：2012/1/20 ～ 2025/1/1
- ④モデリング品質：99.9%

### 【取引概要】

- ①総取引回数：2,237回
  - ➡年間平均 約170回の取引ペース。最大同時保有ポジションは7つ（ロング最大6ノショート最大7）。
- ②平均獲得PIPS：+5.23pips
  - ➡勝ち平均 +12.67pips、負け平均 -31.56pips。リスクリワード比 約0.40（=勝ち5に対して負け12程度）、勝率 83.2%。
- ③損益分岐率：71.8%
  - ➡勝率との差は +11.4pt。PF 1.95 を背景に、バックテスト上で高い収益性を確認。

### 【特徴】

- ◆バックテスト上の総損益は +1,147,146円（初期証拠金100万円・Lot固定0.10）。
- ◆最大DDは -56,594円（相対DD -5.6%）と小さめ。
- ◆バックテスト期間全体で勝率 83.2% を維持しつつ、PF1.95と高効率で、右肩上がりの資産曲線を形成。

### 【留意すべき点・リスク】

- ◆リスクリワード比が低く、勝率依存型。連敗や一撃の損失で資産カーブが一時的に凹むリスク。
- ◆バックテスト上、最大DD回復期間は最長 140日（約4か月半）と中長期化する局面もあり、資金耐久性が求められる。
- ◆短期売買のため、スプレッド拡大・約定遅延の影響を受けやすい。実運用ではブローカー条件に注意。

### 【補足】

本資料はバックテスト結果に基づいて特徴を整理したものであり、将来の成果を保証するものではありません。  
実際の取引環境（スプレッド、約定速度、口座条件など）によって結果が異なる可能性があります。