



Room_F_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：2012/1/2～2025/1/1
- ④モデリング品質：99.9%

【取引概要】

- ①総取引回数：8,425回
 - ➡年間平均 約650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7ノショート最大6）。
- ②平均獲得PIPS：+3.53pips
 - ➡勝ち平均 +12.77pips、負け平均 -22.63pips。リスクリワード比 約0.56（＝勝ち13に対して負け23程度）、勝率 73.9%。
- ③損益分岐率：64.6%
 - ➡勝率との差は +9.3pt。PF 1.55 を背景に、バックテスト上で収益性を確認。

【特徴】

- ◆バックテスト上の総損益は +2,824,838円（初期証拠金100万円・Lot固定0.10）。
- ◆最大DDは -168,176円（相対DD -16.2%）と比較的大きいが、PF1.55と勝率73.9%を背景に右肩上がりの資産曲線を形成。
- ◆バックテスト期間全体で利益を積み重ね、長期的に見て成長性を維持。

【留意すべき点・リスク】

- ◆リスクリワードが低く（勝ち12.8pipsに対し負け22.6pips）、勝率依存型のロジック。勝率が低下すると資金減少スピードが速まる。
- ◆バックテスト上、最大DD回復期間は129日と長期化しており、資金耐久性が求められる。
- ◆取引頻度が多め（年間650回）であるため、スプレッド拡大・約定遅延の影響を受けやすく、実運用では成績低下リスクがある。

【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。