

HIDEKICHI-KUN_AM_M5(MT5)の概要（バックテスト結果に基づく紹介）

【設定概要】

- ①通貨：複数
- ②ロット：変動
- ③バックテスト期間：2021/1/4～2025/1/1
- ④モデリング品質：100%

【取引概要】

- ①総取引回数：7,497回
 - ➡約4年間で年平均1,800回超のペース。最大同時保有ポジションは10（ロング最大10／ショート最大4）で多数ポジション設計。
- ②平均獲得PIPS：2.25pips
 - ➡勝ち平均 +20.95pips、負け平均 -19.96pips。リスクリワード比は約1.05（＝勝ち1に対して負け約0.95）。勝率54.3%で、損益分岐率（47.7%）。
- ③損益分岐率：47.7%
 - ➡勝率との差は+6.6pt。PF1.37を背景に、収益性がバックテスト上では確認された。

【特徴】

- ◆バックテスト上の総損益は +873,790円（初期証拠金100万円・変動Lot時）。
- ◆バックテスト期間において、最大ドローダウン：-108,957円（相対DD -11.7%）。年間を通して複数回DD発生が確認される。
- ◆最大同時保有は10ポジションと非常に多く、含み損を抱える局面では資金耐性が求められる。

【留意すべき点・リスク】

- ◆勝率（54.3%）とリスクリワード比（1.05）が接近しており、勝率低下時には損益が急変しやすい。
- ◆イベント時や相場急変局面ではDDが拡大しやすく、直近でも 最大108,957円の下落 を記録。
- ◆バックテスト期間において、年間の収益変動幅が大きく、2023年は収益が停滞（約+7,700円程度）するなど、波がある。

【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。