



斯々鹿々_M15(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：複数
- ②ロット：0.1Lot
- ③バックテスト期間：2012/1/5～2024/12/28
- ④モデリング品質：99.9%

【取引概要】

- ①総取引回数：4,338回
 - ➡約13年間で年平均333回前後。最大同時保有ポジションは6（ロング最大6／ショート最大6）で複数建て設計。複数建てのため取引回数が増えるのは設計上の特徴。
- ②平均獲得PIPS：4.88PIPS
 - ➡勝ち平均は+16.01pips、負け平均は-31.68pips。リスクリワード比は約0.51（＝勝ち1に対して負け約2）。勝率76.7%、PF1.68の水準で、勝率依存型のバランスが確認された。
- ③損益分岐率：66.1%
 - ➡勝率76.7%に対し、損益分岐率との差は+10.6%。PF1.68の結果からも収益余力を持つ数値が確認された。

【特徴】

- ◆バックテスト総損益：+2,532,045円（初期証拠金100万円・0.1Lot時）。
- ◆最大ドローダウン：-105,188円（相対 -9.7%）。DD水準は10%未満に収まり、バックテスト上では右肩上がりの推移が見られた。
- ◆最大同時保有ポジションは6。複数ポジションを同時に取る設計のため、取引回数の多さはリスク分散効果を持ちつつ、含み損も抱えやすい特徴がある。

【留意すべき点・リスク】

- ◆平均損失幅（-31.68pips）が平均利益（+16.01pips）の約2倍。勝率に依存する設計のため、勝率が低下した局面では成績の振れ幅が大きくなりやすい。
- ◆複数建ての特性により、含み損が一時的に増えるケースや、DD回復に時間がかかることがある（バックテスト上の最大回復期間は約93日）。
- ◆通貨間の相関やイベント集中（指標発表・要人発言等）による同時ドローダウンに注意が必要。

【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。