



LUNA_MT5_M1(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：0.1
- ③バックテスト期間：2021/1/4～2025/1/1
- ④モデリング品質：100% リアルティック

【取引概要】

- ①総取引回数：2,414回
 - ➡約4年間で年間平均600回前後のペース。最大同時保有ポジションは2。
- ②平均獲得PIPS：2.45pips
 - ➡勝ち平均 +26.85pips、負け平均 -21.25pips。リスクリワード比は約0.84（＝勝ち1に対して負け1.2前後）。勝率49.3%。
- ③損益分岐率：44.2%
 - ➡勝率との乖離は+5.1pt。PF1.23を背景に、トータルで黒字を確認。

【特徴】

- ◆バックテスト上の総損益は +602,691円（初期証拠金100万円・Lot固定0.1）。
- ◆最大DDは -61,529円（相対DD -5.8%）と比較的低め。
- ◆バックテスト期間において、PF1.23・勝率49%と決して高くはないが、長期で右肩上がりの利益を維持。

【留意すべき点・リスク】

- ◆勝率が50%未満であり、収益の積み上げはリスクリワード次第。
- ◆バックテスト期間内において、大きな月間マイナスも存在（例：2023年7月 -38,660円、2024年9月 -31,122円）。ドローダウン局面は覚悟が必要。
- ◆複数ポジション（最大2）を同時に持つため、DD発生時のインパクトがやや大きい。

【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。