

Assye_GBPJPY_Lite_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：GBPJPY
- 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：99%

【取引概要】

- ①総取引回数：1,016回
 - ➡約4年間で年間平均250回前後のペース。最大同時保有ポジションは1。
- ②平均獲得PIPS：3.66pips
 - ➡勝ち平均 +29.66pips、負け平均 -35.57pips。リスクリワード比は約0.83（＝勝ち1に対して負け1.2前後）。勝率60.2%。
- ③損益分岐率：54.5%
 - ➡勝率との差は+5.7pt。PF1.27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 +392,005円（初期証拠金100万円・Lot固定0.1）。
- ◆最大DDは -61,787円（相対DD -5.8%）で比較的低め。
- ◆バックテスト期間において、勝率60%、PF1.27。低リスクリワードながらも勝率優位性により収益を確保。

【留意すべき点・リスク】

- ◆リスクリワード比は0.83と低めで、勝率依存型のタイプ。勝率が低下すると収益性も落ちやすい。
- ◆バックテスト期間内において、月単位では2021年7月（-17,651円）、2022年1月（-36,261円）、2023年11月（-27,695円）など、大きな下振れあり。
- ◆バックテスト上で、直近2024年も年間では+61,705円の黒字だが、7月（-13,643円）、10月（-11,058円）など下落局面も目立つ。

【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。