



COPQ_EURUSD_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：EURUSD
- ②ロット：0.03
- ③バックテスト期間：2012/1/3 ～ 2025/1/1
- ④モデリング品質：99.9%

【取引概要】

- ①総取引回数：6,882回
 - ➡年間平均 約530回の取引ペース。最大同時保有ポジションは11（ロング最大7 / ショート最大7）。
- ②平均獲得PIPS：+2.37pips
 - ➡勝ち平均 +13.02pips、負け平均 -21.04pips。リスクリワード比 約0.62（=勝ち13に対して負け21）、勝率 68.8%。
- ③損益分岐率：61.9%
 - ➡勝率との差は +6.9pt。PF 1.35 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 +708,419円（初期証拠金100万円・Lot固定0.03）。
- ◆最大DDは -91,606円（相対DD -8.4%）と中程度。
- ◆バックテスト期間全体で勝率68.8%を維持しつつ、PF 1.35 によって堅調な右肩上がりの資産曲線を形成。

【留意すべき点・リスク】

- ◆リスクリワード比が低く（勝ち13pipsに対し負け21pips）、損小利大ではなく利小損大の設計となるため、資金減少局面が発生しやすい。
- ◆バックテスト上、最大DD回復期間が約434日（約1年2か月）と長期化しており、資金耐久性が求められる。
- ◆平均獲得pipsが小さい（+2.37pips）ため、スプレッドや約定条件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。