

510_Fortune_USDJPY_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：USDJPY
- ②ロット：0.25Lot
- ③バックテスト期間：2012/1/4～2024/12/25
- ④モデリング品質：99.9%

【取引概要】

- ①総取引回数：795回
 - ➡バックテスト期間の約13年間で年間60回前後。短期売買を基本としつつも、エントリー頻度は控えめ。
- ②平均獲得PIPS：6.72PIPS
 - ➡勝ち平均は+25.22pips、負け平均は-25.67pips。リスクリワード比は約0.98（＝勝ち1に対して負け1.02）。勝率は63.6%と比較的高水準で、PF2.14を達成。勝率とPFのバランスで収益を積み重ねるタイプ。
- ③損益分岐率：45.0%
 - ➡勝率63.6%に対し、損益分岐率との差は18.6%。十分な余裕を持ち、成績の安定性を裏付ける数値。

【特徴】

- ◆バックテスト上では総損益+1,881,950円（初期証拠金100万円・0.25Lot時）を記録。
- ◆最大ドローダウンは-7.9%（-81,575円）と比較的浅め。長期にわたり安定した右肩上がりの成長曲線を描いている。
- ◆短期～中期のトレード設計で、月単位ではマイナス月が複数存在するが、長期では一貫してプラス成長を示す。

【留意すべき点・リスク】

- ◆月次単位で大きめのマイナスが散見される（例：2015年2月-28,850円、2023年12月-27,900円など）。短期での変動リスクに注意。
- ◆勝率は安定しているものの、平均損益差が小さく、連敗時にはパフォーマンスが崩れやすい側面を持つ。
- ◆バックテスト上ではドローダウン期間がやや長め（最大DD復帰に440日かかる場面あり）。資金管理に余裕を持った運用が望ましい。

【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。