



家臣2_GOLD_M5(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：XAUUSD
- ②ロット：0.1Lot
- ③バックテスト期間：2021/1/13～2024/12/27
- ④モデリング品質：100%

【取引概要】

- ①総取引回数：201回
 - ➡バックテスト期間の約4年間で、50回/年程度、デイトレEAの部類では少し取引回数は少ない印象です。
- ②平均獲得PIPS：12.08PIPS
 - ➡勝ち平均は +47.86pips、負け平均は -87.83pips。このため リスクリワード比は約0.54（＝勝ち1に対して負け1.63）となっています。
 - 「1回あたりの利益より損失の方が大きい」設計で、“勝率依存型”のEAと言えます。
 - このタイプのEAは、一般論として勝率が下がった場合に成績へ影響を受けやすいという特徴もあります。
- ③損益分岐率：64.5%
 - ➡勝率73.6%に対し、損益分岐率との差が9.1%。スプレッド耐性を図る一つの参考となります。

【特徴】

- ◆『勝率依存型』の性質上、勝率が高く、取引の多くでプラス決済が多くみられる傾向。
- ◆バックテスト期間上の最大ドローダウンは0.1Lot時、約-7.5%（約75,000円／初期証拠金100万円）と、相対的に資金耐性はある程度確認できる。
- ◆試行回数が比較的少ない分、複数稼働時にレバレッジや資金管理が比較的しやすい。

【留意すべき点・リスク】

- ◆リスクリワード比が0.5台と低いため、勝率が下がると成績への影響が大きくなる可能性あり。
- ◆平均利益＜平均損失のため、短期的な収益変動（ドローダウンが深く感じやすい）に注意が必要。
- ◆年間の取引回数が少ないため、試行回数で収束を狙うEAの性質上、DD期間が長くなる可能性も比較的高い。

【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。