



RIZE_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：EURUSD
- ②ロット：0.12
- ③バックテスト期間：2021/1/6～2024/12/28
- ④モデリング品質：99%

【取引概要】

- ①総取引回数：858回
 - ➡約4年間で平均年間214回のペース。最大同時保有ポジションは5（ロング最大1／ショート最大3）。
- ②平均獲得PIPS：2.27pips
 - ➡勝ち平均 +9.61pips、負け平均 -14.12pips。リスクリワード比は約0.68（＝勝ち1に対して負け1.47）。勝率69.1%。
- ③損益分岐率：59.1%
 - ➡勝率との差は+10pt。PF1.55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 +323,720円（初期証拠金100万円・Lot固定0.12）。
- ◆最大DDは -44,798円（相対DD -4.5%）で比較的低め。
- ◆バックテスト期間において、勝率69.1%、PF1.55。比較的中ドルレンジの保持時間（平均約5時間／中央値約4時間）で回転率も良好。

【留意すべき点・リスク】

- ◆リスクリワード比が0.68と低めで、勝率依存型。勝率が落ちると収益性が崩れやすい傾向。
- ◆バックテスト期間において、2022年はマイナス年度を記録しており、相場環境変化に左右される可能性あり。
- ◆スワップがマイナス方向に出ており、長期保有のコストは小さいが存在。

【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。