

## RGM-86T\_AUDCAD\_M30(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：AUDCAD
- ②ロット：0.18
- ③バックテスト期間：2021/1/28～2024/12/12
- ④モデリング品質：100%

### 【取引概要】

- ①総取引回数：215回
  - ➡年間平均 約70回前後のエントリー。最大同時保有ポジションは1つ。
- ②平均獲得PIPS：+5.90pips
  - ➡勝ち平均 +16.95pips、負け平均 -35.83pips。  
リスクリワード比は約0.47（＝勝ち1に対して負け約2.1）。勝率79.1%。
- ③損益分岐率：66.9%
  - ➡勝率との差は+12.2pt。PF1.82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 +240,477円（初期証拠金100万円・Lot固定0.18）。
- ◆最大DDは -62,776円（相対DD -6.1%）と比較的低め。
- ◆バックテスト期間全体で高勝率（79.1%）を維持しながら、PF1.82で右肩上がりの推移を記録。

### 【留意すべき点・リスク】

- ◆リスクリワードは0.5を下回り、勝率依存型の戦略。勝率が低下すると収益性が落ちやすい。
- ◆バックテスト期間内において、単月で大きなマイナスを計上するケースも確認（例：2022年2月 -48,151円、2021年3月 -23,259円など）。
- ◆ドローダウン発生時は比較的長期化するケースもあり（DD回復期間109日）、資金管理・耐久性に注意が必要。

### 【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。