



財宝1_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：0.07Lot
- ③バックテスト期間：2012/1/2～2025/1/1
- ④モデリング品質：99.9%

【取引概要】

- ①総取引回数：5,505回
 - ➡バックテスト期間の約13年間で年平均423回前後。
最大同時保有ポジションが6（ロング最大4ノショート最大3）で複数建てを行うため、取引回数は多めとなる設計。
- ②平均獲得PIPS：3.66PIPS
 - ➡勝ち平均は+16.15pips、負け平均は-17.70pips。リスクリワード比は約0.91（＝勝ち1に対して負け1.09）。
勝率63.1%と比較的高水準で、PF1.90を達成。短期決済を積み重ねて利益を構築するタイプ。
- ③損益分岐率：47.3%
 - ➡勝率63.1%に対し、損益分岐率との差は15.8%。PFの高さを背景に、収益性の余裕を持つ設計。

【特徴】

- ◆バックテスト上では総損益+2,068,472円（初期証拠金100万円・0.07Lot時）を記録。長期的に右肩上がりの成長を維持。
- ◆最大ドローダウンは-8.3%（-84,141円）で比較的浅め。損益曲線は安定しており、長期運用を前提に適している。
- ◆複数ポジションを同時に保有する設計（最大6ポジション）で、取引数の多さはリスク分散効果を持つ一方、含み損を抱えやすい特徴もある。

【留意すべき点・リスク】

- ◆複数ポジションを同時に保有するため、DD回復に時間がかかるケースがある（最大DD回復期間は360日）。
- ◆取引回数の多さは分散効果となる一方、急変動局面では同時建玉によりドローダウンが拡大するリスクあり。
- ◆損失平均が-17.7pipsと勝ちより大きく、勝率に依存する設計のため、勝率低下時には成績悪化リスクがある。

【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。