



家臣2_GOLD_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：XAUUSD
- ②ロット：0.1Lot
- ③バックテスト期間：2012/1/18～2024/12/25
- ④モデリング品質：99.9%

【取引概要】

- ①総取引回数：575回
 - ➡バックテスト期間の約13年間で年間平均45回程度。比較的低頻度で、ゴールドの大きな値動きを狙うスイング寄りの設計。
- ②平均獲得PIPS：15.55PIPS
 - ➡勝ち平均は +43.71pips、負け平均は -79.92pips。リスクリワード比は約0.55（＝勝ち1に対して負け1.83）。
勝率77.2%と高水準で、勝率依存型の設計といえる。
- ③損益分岐率：65.5%
 - ➡勝率77.2%に対し、損益分岐率との差は11.7%。安定性を示す。

【特徴】

- ◆バックテスト上では総損益 +1,253,314円（初期証拠金100万円・0.1Lot時）を記録し、長期的に右肩上がりの成長を示している。
- ◆最大ドローダウンは -7.9%（-79,330円／初期証拠金100万円）と比較的浅めで、資金効率と安定性に優れる。
- ◆取引回数は少なめだが、ゴールドのトレンド局面を捉えたスイング志向の取引スタイル。

【留意すべき点・リスク】

- ◆バックテスト上、平均損失が大きめ（-79.9pips）なため、勝率低下局面では成績が崩れるリスクあり。
- ◆ゴールドの特性上、相場急変時にはドローダウンが拡大するリスクがあるため、資金管理が重要。
- ◆バックテスト上では年間ベースでマイナス年は確認されていないが、月次単位では大きな下振れが複数存在しており、短期的な収益変動には注意が必要。

【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。