



LUNA(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：複数
- ②ロット：0.1
- ③バックテスト期間：2012/1/3～2025/1/1
- ④モデリング品質：99.9%

【取引概要】

- ①総取引回数：8,260回
 - ➡約13年間で年間平均630回前後のペース。最大同時保有ポジションは3つ。
- ②平均獲得PIPS：2.62pips
 - ➡勝ち平均 +24.57pips、負け平均 -17.40pips。リスクリワード比は約0.85（＝勝ち1に対して負け1.2弱）。勝率47.7%。
- ③損益分岐率：41.4%
 - ➡勝率との差は+6.3pt。PF1.29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 +2,193,653円（初期証拠金100万円・Lot固定0.1）。
- ◆最大DDは -77,168円（相対DD -7.1%）と比較的低め。
- ◆バックテスト期間全体で勝率は50%を下回るものの、取引回数が多く、トータルでは右肩上がりの成長。

【留意すべき点・リスク】

- ◆リスクリワードは0.85程度で、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。
- ◆バックテスト上、単月ベースで大きめのマイナスがある（例：2014年2月 -16,257円、2020年9月 -31,929円、2024年12月 -16,320円）。
- ◆短期的な荒れによりドローダウンを伴うこともあり、資金管理には余裕が必要。

【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。