



MIX_USDJPY_M15(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：0.1
- 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：5,597回
 - ➡年間平均 約430回の取引ペース。最大同時保有ポジションは6つ。
- ②平均獲得PIPS：+3.48pips
 - ➡ 勝ち平均 +16.45pips、負け平均 -28.02pips。リスクリワード比 約0.59（＝勝ち1に対して負け1.7程度）、勝率 70.8%。
- ③損益分岐率：63.6%
 - ➡勝率との差は +7.2pt。PF1.39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 +1,816,246円（初期証拠金100万）。
- ◆最大DDは -153,652円（相対DD -14.3%）と中程度。
- ◆バックテスト期間全体で期待値は +324.8円、標準偏差は2,783円。

【留意すべき点・リスク】

- ◆リスクリワードが低め（勝ちに対して負けが大きい）ため、ドローダウン発生時の資金減少スピードに注意。
- ◆最大DDの回復期間は最長 480日20時間15分 と長期化。中長期の資金耐久性を求められる。
- ◆バックテスト上、勝率が高い一方で、平均損失が平均利益の約1.7倍と大きい。連敗時の損失が利益を一気に削る可能性があり、資金管理を怠ると大幅なドローダウンに繋がる。

【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。