



RIZE_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：EURUSD
- ②ロット：0.12
- ③バックテスト期間：2012/1/3～2024/12/28
- ④モデリング品質：99.9%

【取引概要】

- ①総取引回数：2,624回
 - ➡約13年間で年間平均200回前後のペース。最大同時保有ポジションは5（ロング最大1／ショート最大3）。
- ②平均獲得PIPS：4.32pips
 - ➡勝ち平均 +11.61pips、負け平均 -17.47pips。リスクリワード比は約0.66（＝勝ち1に対して負け1.5前後）。勝率75.0%。
- ③損益分岐率：60.1%
 - ➡勝率との差は+14.9pt。PF1.99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 +2,048,883円（初期証拠金100万円・Lot固定0.12）。
- ◆最大DDは -90,278円（相対DD -7.3%）で比較的低め。
- ◆バックテスト期間において、勝率75%、PF1.99。リスクリワード比は低めだが、高勝率でカバーし収益を確保している。

【留意すべき点・リスク】

- ◆リスクリワード比は0.66と低く、勝率に依存するタイプ。勝率が低下すると収益性も急落しやすい。
- ◆バックテスト期間内において、比較的短期回転型（平均保有時間 約6時間）であり、スプレッドや約定スリッページの影響を受けやすい。
- ◆バックテスト上で、直近2022年・2023年はいずれも年間プラスで推移。ただし月単位では大きなマイナスも存在。

【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。