



AssyeGBP(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：GBPJPY
- ②ロット：0.1
- ③バックテスト期間：2012/1/2～2024/12/31
- ④モデリング品質：99.9%

【取引概要】

- ①総取引回数：3,050回
 - ➡約13年間で年間平均230回前後のペース。最大同時保有ポジションは2つ。
- ②平均獲得PIPS：2.87pips
 - ➡勝ち平均 +28.54pips、負け平均 -33.46pips。リスクリワード比は約0.85（＝勝ち1に対して負け1.2前後）。勝率58.6%。
- ③損益分岐率：53.9%
 - ➡勝率との差は+4.7pt。PF1.21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 +903,502円（初期証拠金100万・Lot固定0.1）。
- ◆最大DDは -88,146円（相対DD -8.3%）。
- ◆バックテスト期間全体で見れば右肩上がりの成長だが、最大で約1年半続く停滞期（2013～2014年など）が存在。

【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。勝率が下がると収益性が低下しやすい。
- ◆バックテスト上、単月ベースではマイナスも多く、例えば 2013年 -141,506円、2023年 -33,610円 と年間マイナス期もある。
- ◆長期的には利益を積み上げているが、中期的な停滞や荒れ相場には要注意。

【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。