

FX自動売買 分析レポート

Step 1：統計要約

項目	値
トレード期間	2023-04-03 ~ 2023-09-29
総トレード数	116
総損益 (円)	1,580,400
勝ちトレード数・損益	66 回 / +4,470,700 円
負けトレード数・損失	50 回 / -2,890,300 円
勝率 (%)	56.90 %
プロフィットファクター	1.55
平均リスクリワード	1.17
平均損益	13,624.14 円
平均pips	63.46 pips
最大ドローダウン	-321,600 円 / -16.91 %

Step 2：グラフとコメント

Cumulative Profit (累積損益)



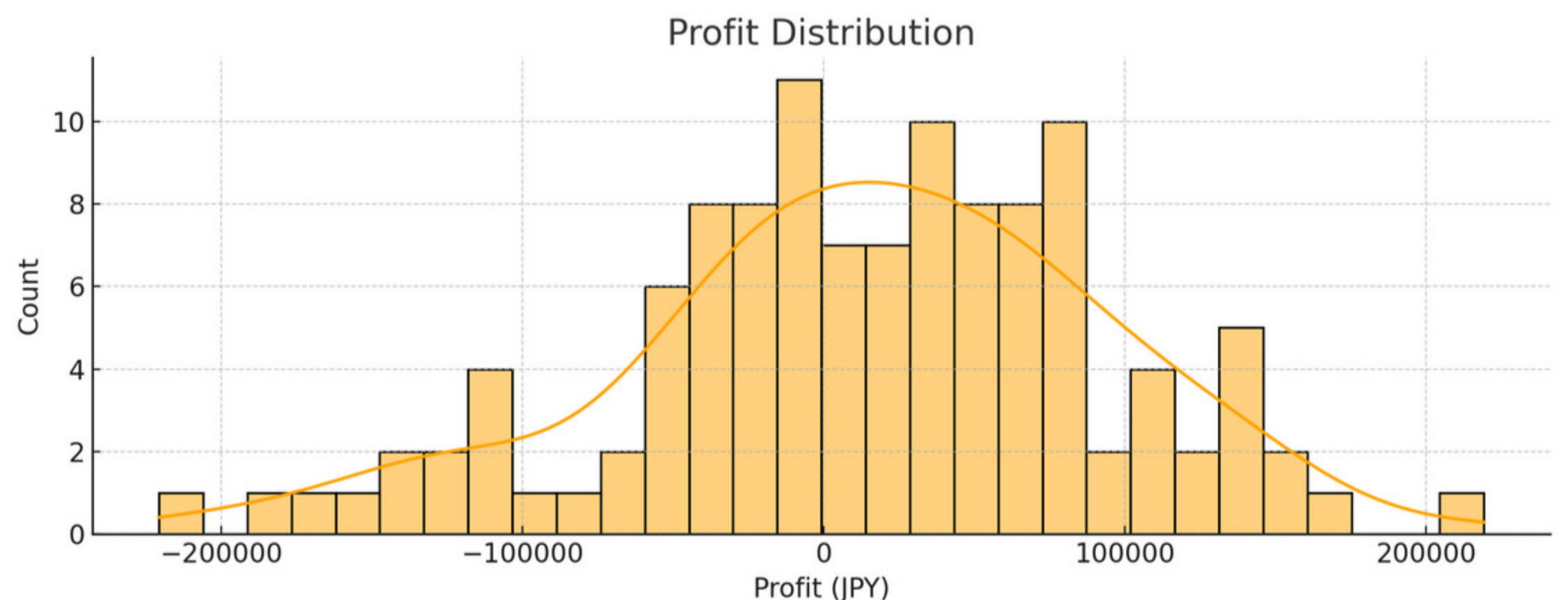
累積損益は右肩上がりで推移しており、総じて良好なトレンドが続いています。

Trade-wise Profit (トレードごとの損益)



個々のトレードでは利益と損失のばらつきが見られますが、大きな損失は限定的です。

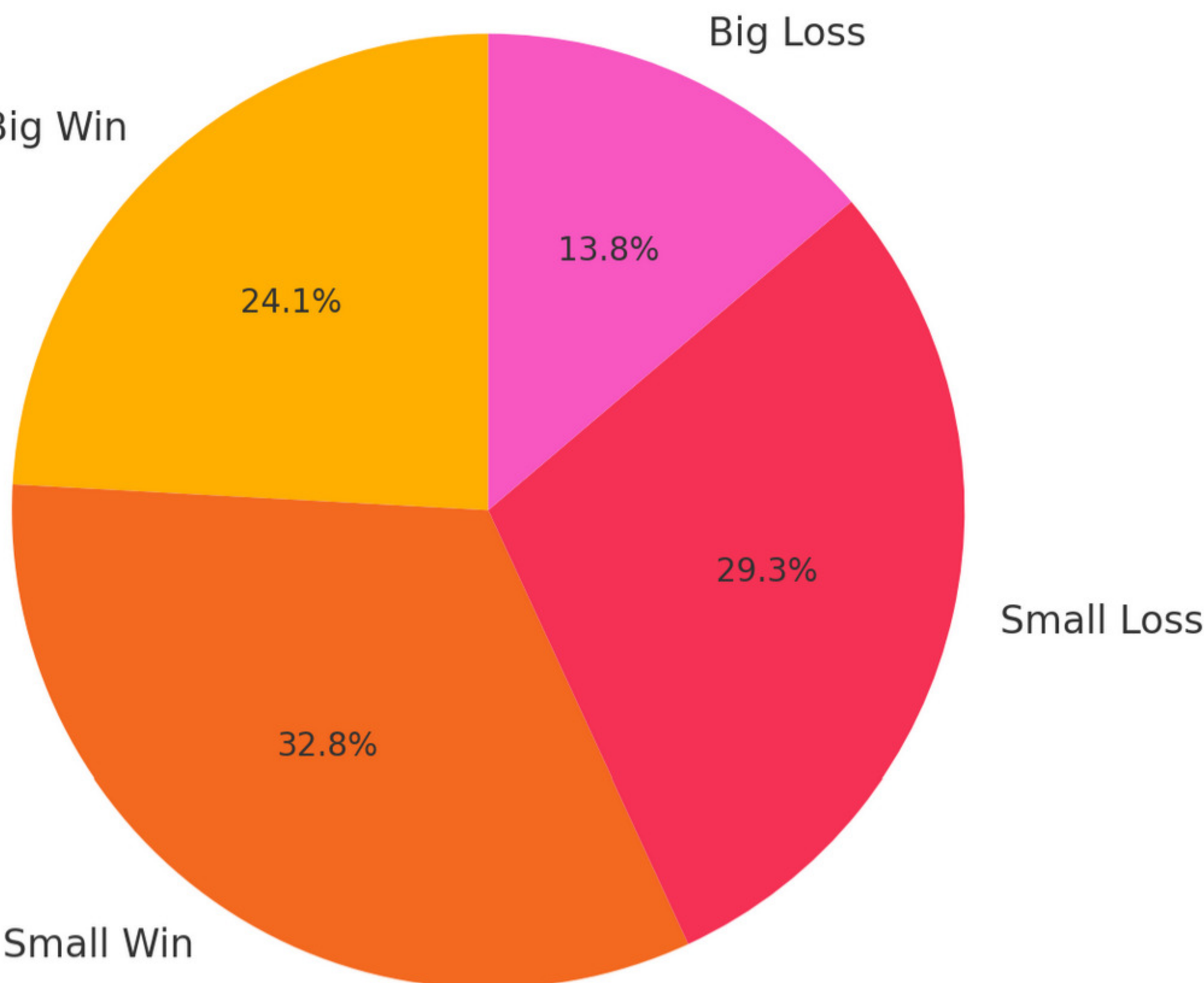
Profit Distribution (損益分布)



分布はやや右に偏っており、利益側に厚みがあります。リスクリワード比のバランスは良好です。

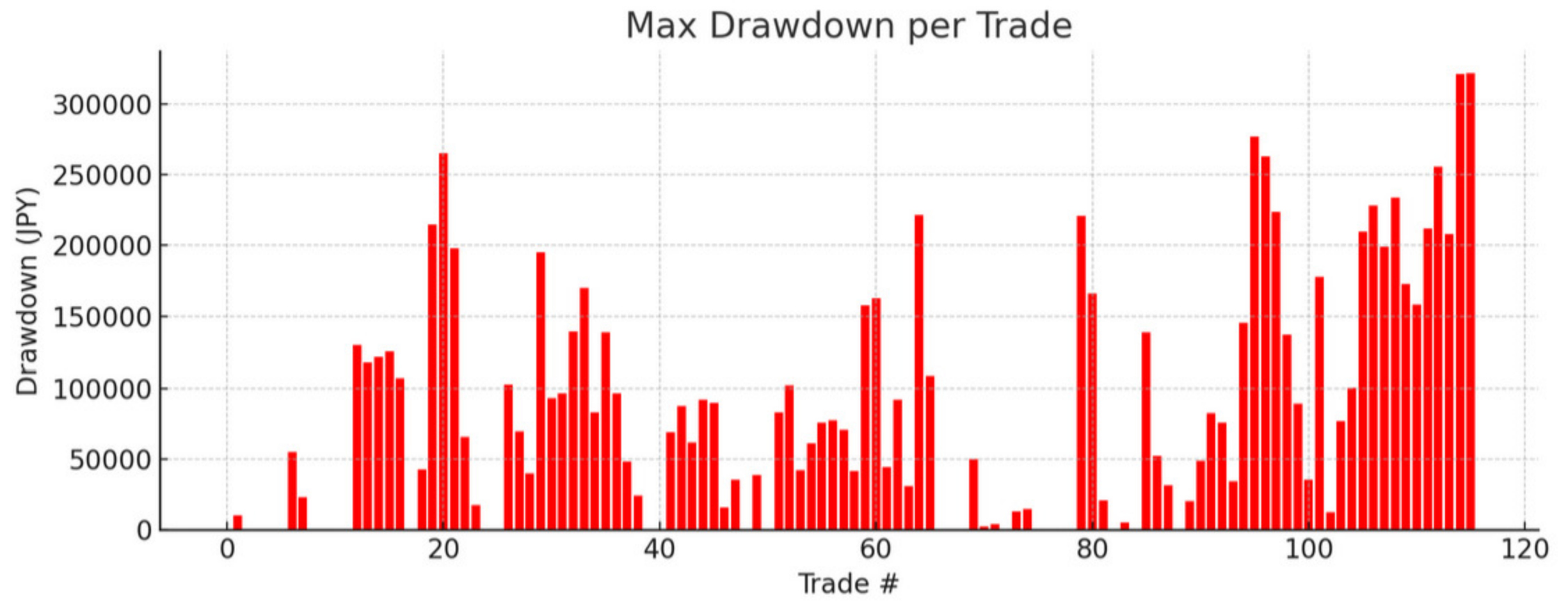
Win/Loss Breakdown (勝敗内訳)

Win/Loss Breakdown



小さな勝ちが多く、大きな負けが少ない構成で、損益の安定に寄与しています。

Max Drawdown per Trade (トレードごとのDD)



ドローダウンは一定間隔で発生していますが、回復も見られます。リスク管理はおおむね良好です。

Step 3：AIジャッジメント

評価項目	スコア	コメント
勝率安定性	B	勝率は一定の安定性を示していますが、改善の余地があります。
ボラティリティ対応力	A	大きな利益を狙いつつ損失を抑える運用ができています。
リスク管理	A	プロフィットファクターが高く、ドローダウンも抑えられています。
総合評価	A	安定性・対応力・リスク管理の三拍子が揃った優秀なシステムです。

Step 4：課題と改善提案

課題	内容	改善案
勝率の安定性に若干の波がある	全体の勝率は50%を超えているものの、安定性には欠け、連敗による資金減少の可能性がある。	勝率の低下が起こるタイミングを特定し、フィルタ条件やロジックの強化を検討する。
最大ドローダウンの発生	最大ドローダウンが -321,600円 (-16.91%) と比較的大きい。	トレーリングストップやポジションサイズ制限の導入により、リスクを動的に抑制する。
一部トレードでの損益振れ幅が大きい	大きな勝ち負けが混在しており、期待値のブレが大きい。	平均リスクリワードを維持しつつ、極端なリスク・リワード比を避ける戦略に変更する。