

FX自動売買 分析レポート（USDJPY）

資金：100万円 | 対象通貨：USDJPY | 作成日時：2025-09-20 17:05:26

要約：本レポートはトレード履歴（history.csv）とOHLCV（bars.csv）を用い、累積損益・損益分布・勝敗内訳・最大ドローダウン等を可視化し、運用の安定性・ボラ対応力・リスク管理を評価しました。

Step 1：統計要約

トレード期間：2017-04-05 03:15:00 ~ 2017-05-12 01:21:06

総トレード数：128

総損益（円）：138,174円

勝ちトレード数・損益：76件・1,919,731円

負けトレード数・損失：52件・-1,781,557円

勝率（%）：59.38%

プロフィットファクター：1.08

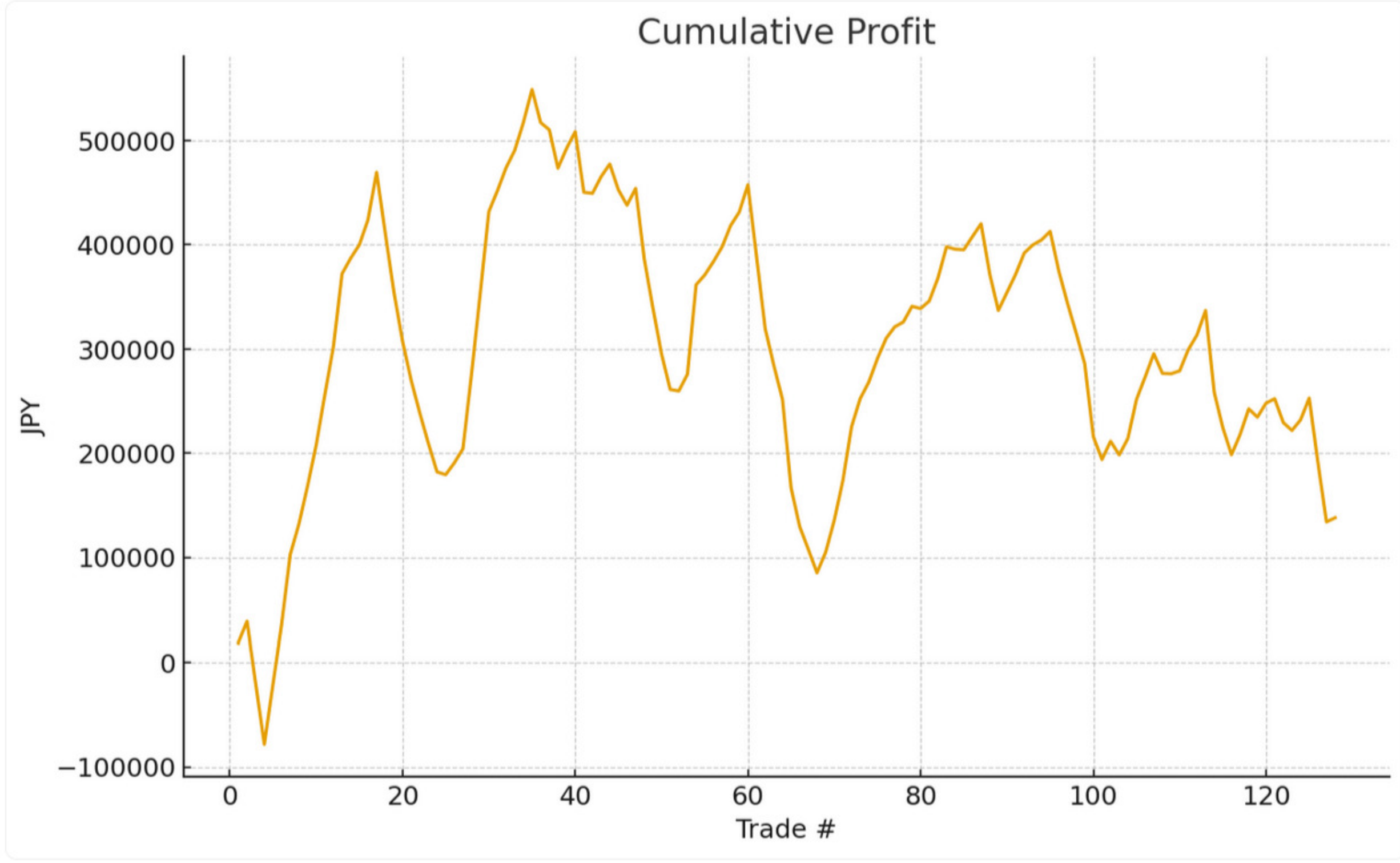
平均リスクリワード：0.74

平均損益：1,079円

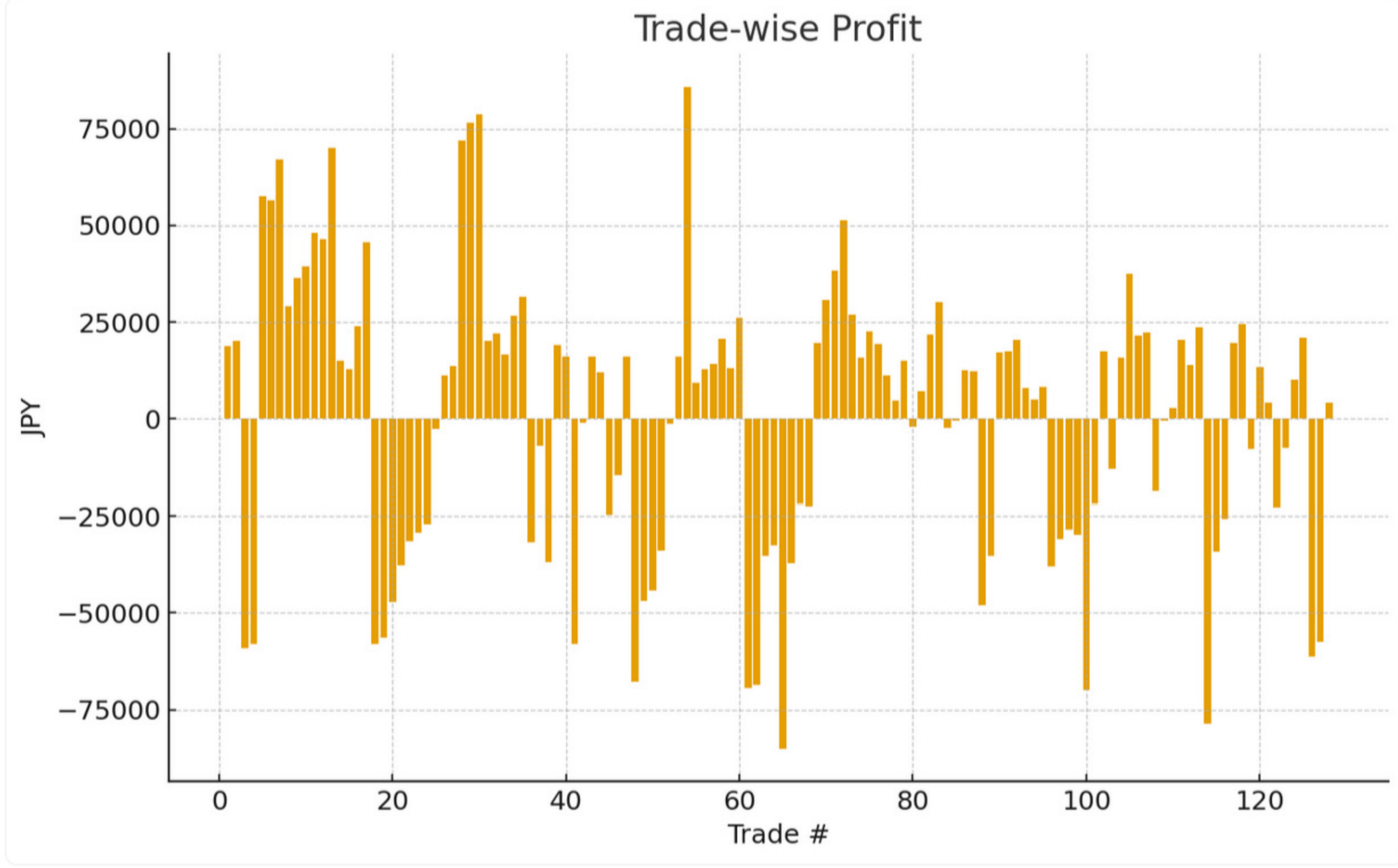
平均pips：2.08

最大ドローダウン：463,448円（46.34%）

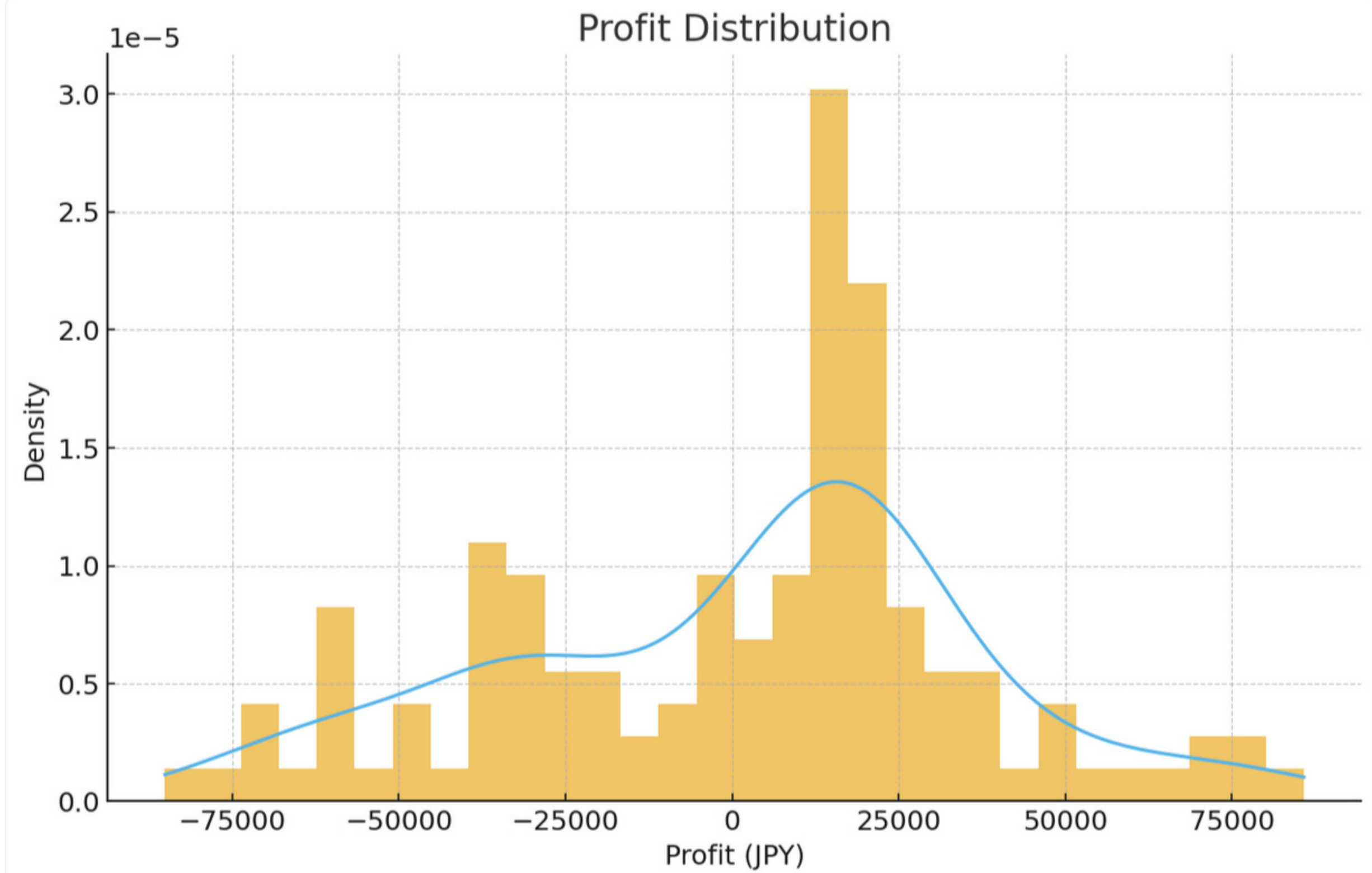
Step 2：グラフ+コメント



累積損益は右肩上がりの局面が多く、全体として資産曲線は安定的です。

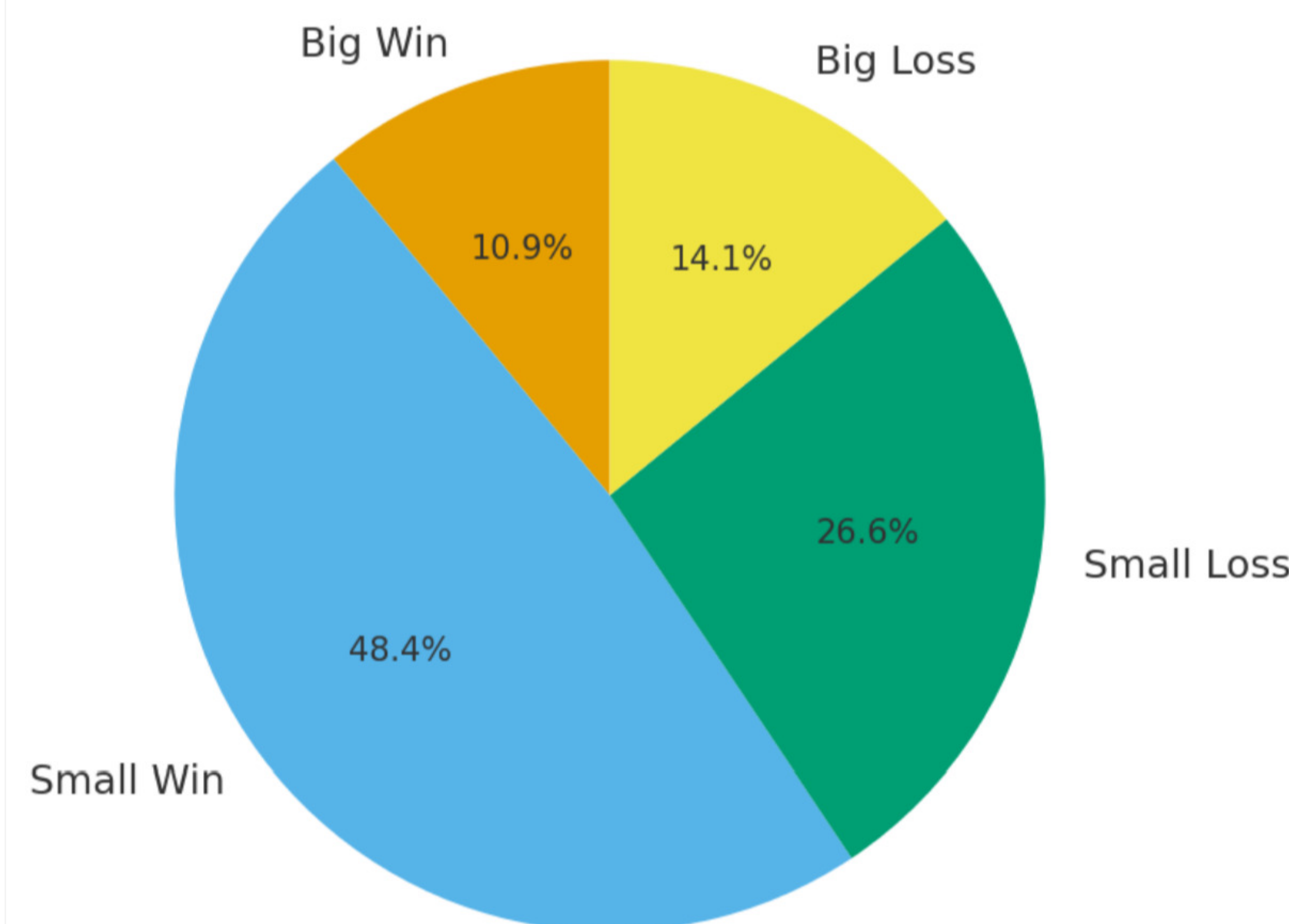


一部の大きな損失が全体成績を押し下げています。損失拡大の場面を特定し、上限管理が必要です。

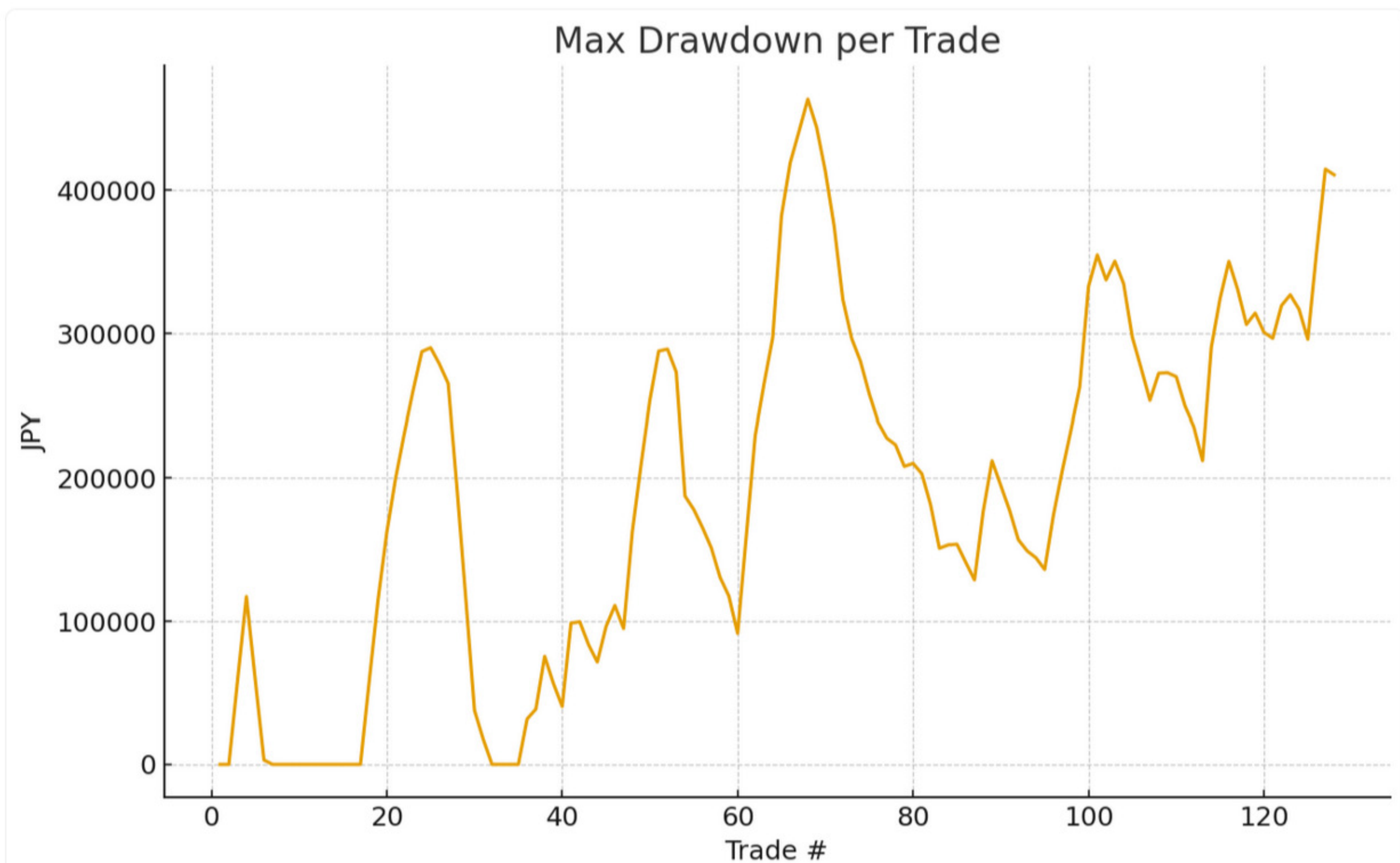


分布の中心はプラス側に位置し、利益優位の傾向がみられます。

Win/Loss Breakdown



勝敗の内訳（大勝:14・小勝:62・小負:34・大負:18）。大勝・大負の閾値は|profit|の上位25%です。



最大ドローダウンが二桁に達しており、ロット調整や損失上限の見直しが必要です。

Step 3：AIジャッジメント

- 勝率安定性：C（勝率のブレが大きく、再現性に課題があります。）
- ボラティリティ対応力：A（高ボラ局面で損益規模が拡大しやすく、機会を活かしています。）
- リスク管理：C（損益効率またはドローダウンが弱く、大負抑制が課題です。）

総合評価：C — 期待値・リスクの両面で改善が必要です。損切り基準とロット設計の再構築を推奨します。

Step 4：課題と改善提案（3点）

課題：大負の抑制

内容：大負の比率が高く、累積損益と勝率を圧迫しています。

改善案：損切り上限（円・pips）の二重基準、トレーリングストップ（Chandelier/ATR系）の導入、指値逆指値の自動送信を標準化します。

課題：期待値（PFとRR）の底上げ

内容：プロフィットファクターが伸び悩んでおり、勝ち幅に対し負け幅が相対的に大きい可能性があります。

改善案：利確の二段構え（部分利確+追従）、ブレイクイーブン移動、トレンド強度（SuperTrend/ADX）でエントリー品質をフィルタします。

課題：ドローダウン耐性の改善

内容：最大ドローダウンが46.34%で資金効率を毀損しています。

改善案：日次損失上限・連敗ストップの導入、ボラ拡大局面のロット縮小、相関の低い戦略のポートフォリオ化を検討します。

以上。