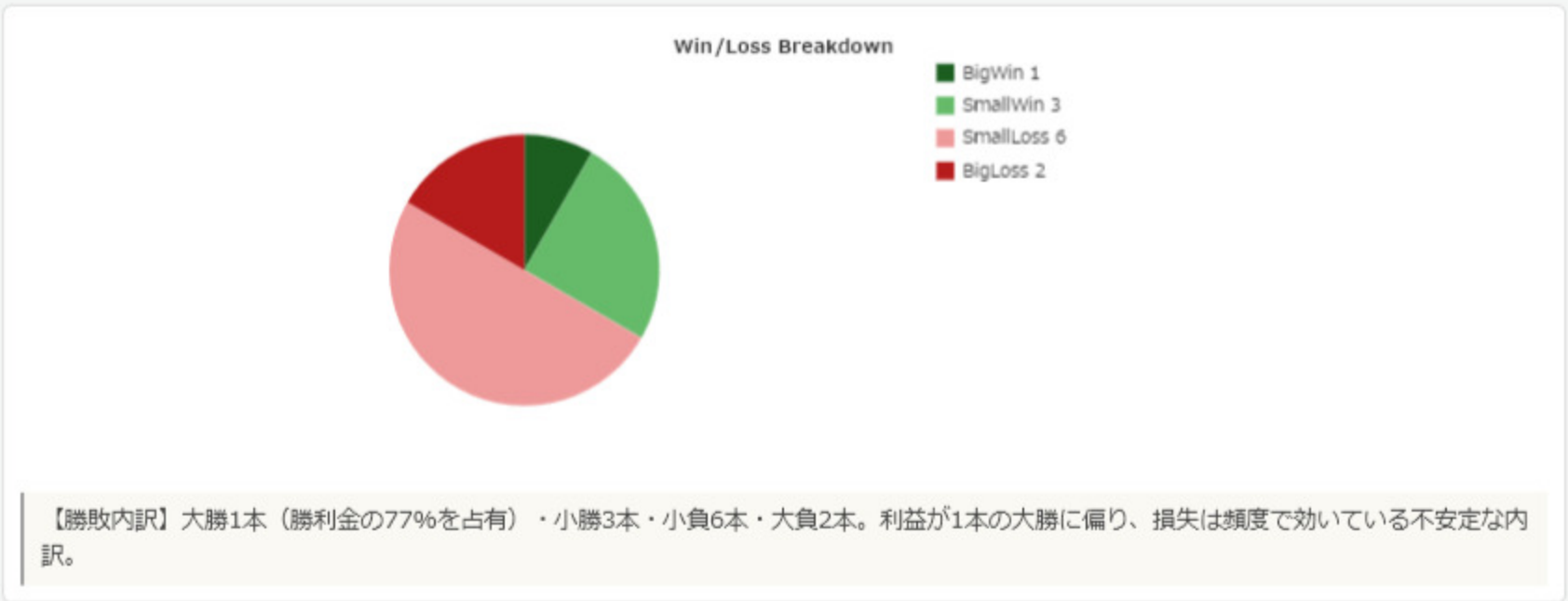
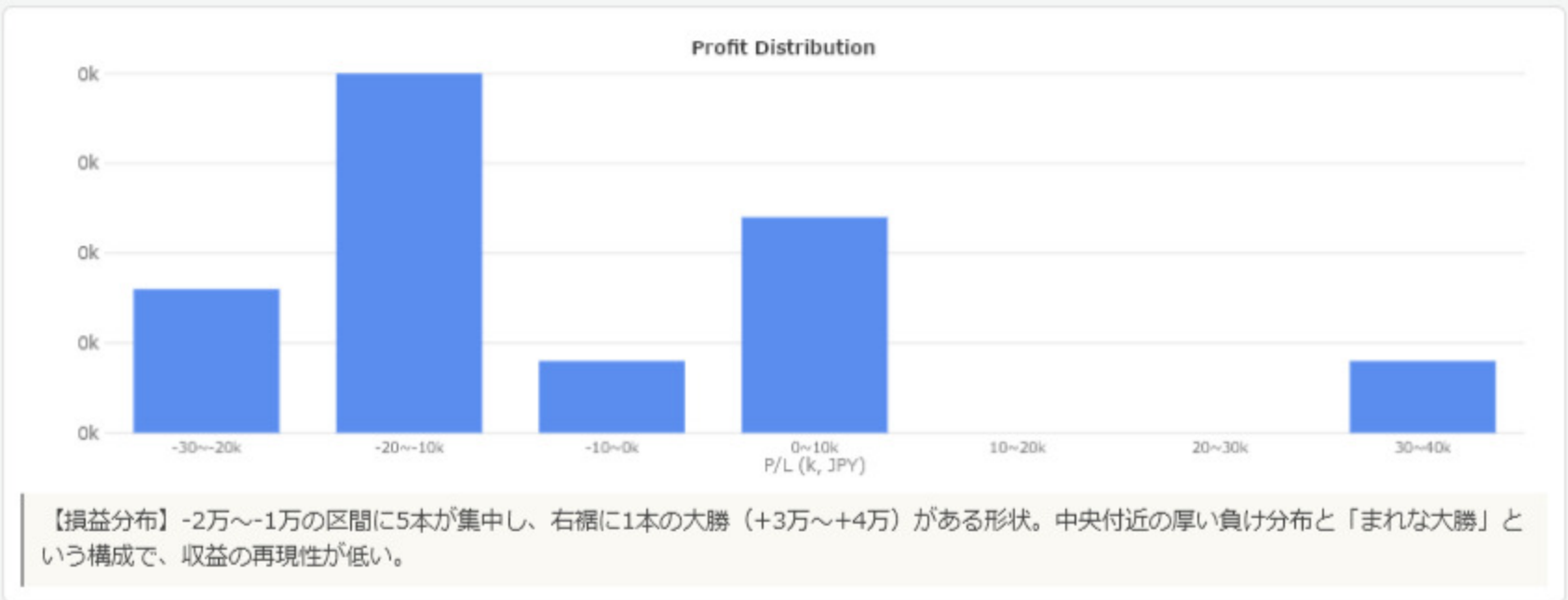


Step 1：統計要約

項目	値
トレード期間	2026.03.21 23:59 ~ 2026.04.03 19:59 (約13日間)
総トレード数	12
総損益 (P/L+スワップ+手数料)	-65,230.5 (口座通貨建て。JPY建てと推定されるが単位不明のため「口座通貨建て」表記)
勝ちトレード数・勝ち損益合計	4本 / +48,639.2
負けトレード数・負け損失合計	8本 / -113,869.7
勝率	33.3% (4/12)
プロフィットファクター (総利益÷ 総損失)	0.43
平均リスクリワード (平均勝ち÷ 平均負け)	0.85 (12,159.8 ÷ 14,233.7)
平均損益 (総損益÷トレード数)	-5,435.9
平均pips	銘柄不明のため算出不可 (レポート末尾の注記参照)
最大ドローダウン	113,869.7 (累積損益カーブのピーク+48,639.2 → 谷-65,230.5。ピーク時累積損益に対する比率 234.1%)

スワップ・手数料はデータ上すべて0.0 (列は存在)。ドローダウン定義はレポート末尾の注記に明記。

Step 2：グラフとコメント



参考：トレード詳細とボラティリティ (bars.csvから算出)

#	方向	P/L	保有時間	保有期間の値幅 (高値-安値)	値幅/開始価格
1	SELL	+5,506.4	約38h	605,459	5.41%
2	BUY	+1,355.6	約20h	352,927	3.15%
3	BUY	+4,504.0	約31h	315,879	2.81%
4	SELL	+37,273.2	約51h	277,935	2.51%
5	SELL	-12,668.3	約30h	407,876	3.83%
6	SELL	-12,326.9	約19h	407,876	3.83%
7	SELL	-10,906.9	約15h	407,876	3.82%
8	SELL	-21,856.4	約7h	351,206	3.31%
9	SELL	-20,909.9	約10h	357,502	3.39%
10	BUY	-16,391.4	約28h	350,268	3.24%
11	SELL	-12,750.5	約36h	275,662	2.61%
12	SELL	-6,059.4	約3h	98,752	0.93%

Step 3：AIジャッジメント

勝率安定性：C
勝率33.3% (4/12)・プロフィットファクター0.43。勝利金48,639のうち77%を1本の大勝(#4の+37,273)が占め、5〜12トレード目は8連敗。分布が極端に偏っており、成績の再現性・安定性は低い。
ボラティリティ対応力：C
保有期間の値幅(高値-安値)は0.93%〜5.41%。負け8本のうち6本が値幅3.2〜3.8%の局面で発生しており、動きの大きい局面で逆行エントリー(上昇反発中のSELL、下落中のBUY)が続いた。ボラティリティの大きさに応じた方向判断・利確が機能していない。
リスク管理：C
全トレード固定0.1ロットだが、損切りが無い(損失が-6,059〜-21,856まで拡大)。最大ドローダウン113,870(ピーク累積利益比234%)、最長保有51時間。平均損失14,234>平均利益12,160とリスクリワードも悪化。
総合評価：C
12トレードで-65,231 (-0.65%)の損失。勝率・PF・DDのいずれも改善余地が大きく、現状のロジックには統計的な優位性が認められない。

Step 4：課題と改善提案

課題1：トレンド方向の誤認(逆行エントリー)
内容： 3/29〜4/3の反発局面でSELLを7回連続(#5〜9,11,12)でエントリーし全敗。4/1のBUY(#10)も直後の下落で損失。市場のレンジム(トレンド/レンジ)を識別せずに機械的にエントリーしている。
改善案： 上位時間足(H4/D1)のトレンドフィルターを導入し、トレンド方向のみ順張りエントリー。ADX(14)≥25でトレンド判定、レンジ判定時のみ逆張りを許可する、等の条件を追加する。
課題2：損切り・リスク上限の欠如
内容： 損切りが無いため8連敗で-113,870が累積。平均損失が平均利益を上回る(RR 0.85)非対称リスク。最長保有51時間。
改善案： ATR(14)の1.5倍など動的な損切りを必ず設定。1トレードのリスクを口座残高の1〜2%に固定し、最大ポジション数を制限。保有時間の上限(例：24時間)と時間損切りも併用する。
課題3：サンプル不足と1トレード依存
内容： 12トレードでは統計評価に不十分。勝率33%でも1本の大勝(+37,273)が結果を左右する不安定な構造。
改善案： 最低50〜100トレード分まで検証期間を延長し、バックテスト→デモ口座→少額運用の順で段階的に確認。月次で勝率・PF・DDを見直し、PF<1.0が続く場合はロジック・パラメータを再設計する。

注記 (データ・単位に関する不明点)

- 銘柄：history.csv / bars.csv の価格水準 (約1,060万〜1,190万円台) から、JPY建ての暗号資産CFD (BTCJPY相当) と推定されるが、データに銘柄名が含まれないため「銘柄不明」として扱った。平均pipsは銘柄不明のため算出不可。
- 単位：損益・価格は口座通貨建て (JPYと推定されるが確定できないため「口座通貨建て」表記)。
- 最大ドローダウンの定義：累積損益カーブのピーク (4トレード目終了時 +48,639.2) から谷 (最終 -65,230.5) までの絶対額 113,869.7 を「円」、ピーク時累積損益(+48,639.2)に対する下落率 234.1% を「%」として算出。累積損益がマイナスに転落したため100%を超えている。
- ボラティリティの定義：bars.csv (1時間足) の各トレード開始〜終了時刻区間に含まれるバーの「最大高値-最小安値」を開始価格で除した値幅(%)。
- スワップ・手数料はデータ上すべて0.0として扱った。