

REI_Sample_Nanpin (TeamREIの説明用EA) の検証結果



ご依頼の内容と検証の条件

EA	REI_Sample_Nanpin (TeamRE…	プラン	カスタマイズ
通貨ペア / 時間足	EURUSD / M15	テスト期間	2016-01-04 ~ 2018-01-15
ティックデータ	Dukascopy 実ティック (tickbt …	スプレッド	10 ポイント (1.0 pips) 固定
初期証拠金	10,000 USD	パラメーター	Lots=0.02、RSIPeriod=14、RS…

パラメーター：Lots=0.02、RSIPeriod=14、RSILow=25、RSIHigh=75、GridPips=15、Multiplier=1.6、MaxLevels=8、TakeProfitPips=8

テストは 2016-01-01 ~ 2025-12-31 の予定で始めましたが、2018-01-15 に証拠金がほぼ尽き（残り 10 USD）、それ以降は取引できないまま終わりました。このレポートの成績は、その日までのものです。

危険度：高い（資金を大きく失う形がある）

このEAの弱点（要点）

- ・損切りが無く、逆行するたびにロットを約1.5倍ずつ増やして最大8回まで足す「マーチンゲール型のナンピン」です。
- ・まとめて決済した回の勝率は 99.7% と高い一方、含み損を含めた最大の落ち込みは証拠金の 100% です。
- ・持っていたロットは最大 0.95 ロットで、最初のロットの 48 倍に膨らんでいます。
- ・9通りのうち、損失が落ち込み60%以上になった組み合わせは 6 通り。最後まで資金が持ったのは 3通りと、利確 5pips・RSI 20/80 だけです。設定を少し変えるだけで「最後まで持つ」と「資金切れ」が入れ替わるため、どの設定なら将来も持つかを過去のデータから選ぶことはできません。ご提示の設定も、この入れ替わりの境目にあります。
- ・スプレッドを広げても、証拠金が尽きる時期は基準と同じ 2018年1月です。コストの差より、ナンピンが耐えきれない相場が来るかどうかで結果が決まっています。
- ・期間を良い3年に絞り、スプレッドを狭くすると、純益 3,020・最大の落ち込み 8% の「勝てるEA」に見えます。同じEAを 2016年 から動かすと、2018年1月15日 に証拠金が尽きています。

このレポートで調べたこと

- ✓ 約10年の実ティックでのバックテストと月別・年別の成績
- ✓ ナンピン・マーチンゲール・グリッド・損切りの有無・最大ロット・含み損
- ✓ 成績が「たまたま」でないか（順番の入れ替え・前半と後半・上位取引への依存）
- ✓ パラメーターを動かしたときの崩れ方（過剰最適化の診断）
- ✓ スプレッドを悪くしたとき・現実のコストを引いたときの成績
- ✓ EAの性格と、場面ごとの得意・不得意
- ✓ 販売ページによくある条件で測った成績との比べ
- ✓ 別の通貨ペアでの成績

※ 過去のデータでの検証です。将来の成績を約束するものではありません。使うかどうかはご自身でご判断ください。

REI_Sample_Nanpin (TeamREIの説明用EA)



テスト条件

EA	REI_Sample_Nanpin (TeamRE…	通貨ペア / 時間足	EURUSD / M15
テスト期間	2016-01-04 ~ 2018-01-15	ティックデータ	Dukascopy 実ティック (tickbt …
モデリング品質	—	スプレッド	10 ポイント (1.0 pips) 固定
サーバー時刻	GMT+2 / 米国式夏時間	初期証拠金 / 通貨	10,000 USD
ティック数	273,132,726	作成	2026-09-20 12:44

成績

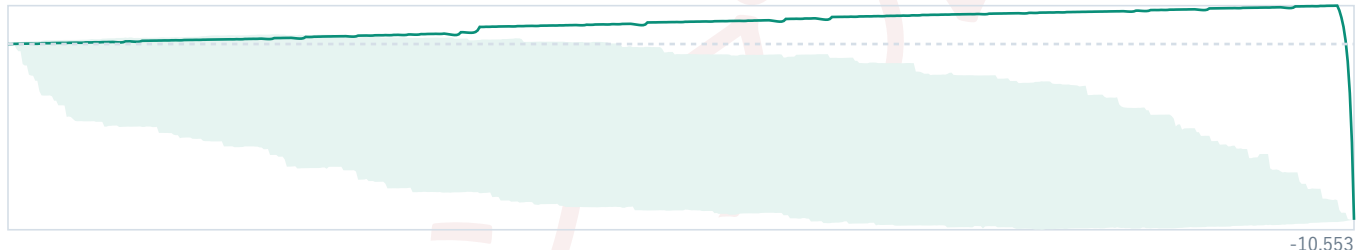
-9,990 純益 (USD)	0.24 プロフィットファクタ	65.2% 勝率	643 取引数
12,171 最大ドローダウン (USD)	-16 1取引あたり (USD)	-0.82 リカバリーファクタ	3.5日 平均保有

検査の判定: 見直しが必要

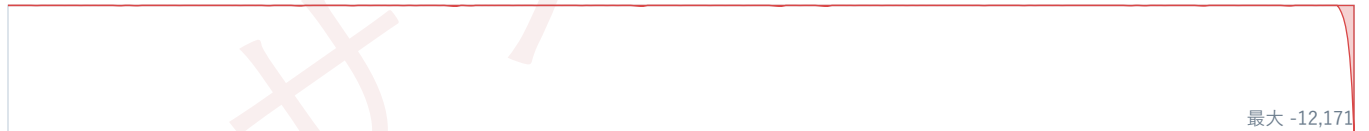
弱点の少なさ 7/100 ×3 △3 ○3

資産推移

決済順の損益の積み上げ (薄い帯 = 取引の順番を入れ替えたときの範囲)



最高値からの落ち込み (ドローダウン)



年×月の損益 (USD)

	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
2016												
2017												
2018												

リスクの点検：ナンピン・マーチンゲール・損切り

見つかった形

損切りの無い建玉	643 / 643 (100%)
逆行してからの買い増し・売り増し	314回 (建玉の49%)
足すときのロットの倍率 (中央)	1.50倍
足す間隔 (中央)	15.1pips (ばらつき13%)
同時に持った数 (最大)	8本
同時に持ったロット (最大)	0.95ロット (最初の48倍)
含み損を含めた最大の落ち込み	12,174 (証拠金の99.9%)
まとめて決済した回の勝率	99.7% (327回)
まとめて決済した回の最大の負け	-12,171

読み方

- ・逆行するたびにロットを約1.5倍ずつ増やして足す「マーチンゲール型のナンピン」です。少し戻れば全部をまとめて利確できるので勝率は高く見えますが、戻らずに一方向へ動き続けると、増えたロット全部が一度に大きな含み損になります。
- ・倍率は設定では 1.6 倍ですが、ロットは0.01刻みに丸められるため、実際の建玉から測ると約 1.50 倍です（この頁の数字はすべて実際の建玉から測っています）。
- ・損切りが1本も置かれていません。相場が戻らなかったときに損失を止める仕組みが無く、証拠金が尽きるまで持ち続ける形です。
- ・一定の間隔（約15pips）ごとに注文を並べる「グリッド」の形をしています。
- ・テストは 2016-01-01 ～ 2025-12-31 の予定で始めましたが、2018-01-15 に証拠金がほぼ尽き（残り 10 USD）、それ以降は取引できないまま終わりました。このレポートの成績は、その日までのものです。
- ・決済した損益だけでなく、持っている間の含み損を含めると、証拠金の100%まで減った時期があります。販売ページの「最大ドローダウン」が決済ベースだと、この数字は出てきません。

判定の基準

- ・ナンピン：逆行した値段で同じ向きに建て増した回が、建て増し全体の8割以上
- ・マーチンゲール：そのときのロットの倍率（中央値）が1.2倍以上
- ・グリッド：足す間隔のばらつき（標準偏差÷平均）が25%未満
- ・危険度「高い」：マーチンゲールかつ、建玉の9割超に損切りが無い

検査：この成績は信用できるか

検査の結果

○ 取引数

643回。判断に足りません。

○ ドローダウンの安定

順番を入れ替えても実測の0.9倍（11,202）に収まります。

△ 並べ替えると負けることがある

取引を引き直すと100%の確率で最終損益が0以下になります。

× 後半で崩れている

前半の利益率 3.46 に対し後半は 0.11（97%の劣化）。期間に合わせ込んでいる疑いがあります。

× 大勝ち数回で出来ている

上位5取引を除くと -10,645 になり、利益が消えます。

× 優位があるとは言えない

1取引あたりの損益は、引き直すと98%の確率で0以下になります（95%の範囲: -34.8 ～ -1.0）。

△ 伸び方が一様でない

資産曲線の直線らしさ 0.47。特定の時期に偏っています。

○ 月ごとの安定

勝ち越した月が94%（18か月中）。

△ 利益が伸びない時期が長い

最高値を更新できない期間が最長251日ありました。実運用では耐えられるかを考える必要があります。

モンテカルロ（取引の順番を入れ替えたとき）

実測の最大ドローダウン	12,171	中央値	10,499
95%地点	11,202	99%地点	11,464
95%地点 ÷ 実測	0.92倍	引き直して損になる確率	100.0%

資金は「実測の最大ドローダウン」ではなく、95%地点を耐えられる前提で用意するのが安全です。

前半と後半（合わせ込みの確認）

前半のPF	3.46	後半のPF	0.11
前半の損益	1,247	後半の損益	-11,237
劣化	97% 悪化	分かれ目	2016-09-07

その他の指標

SQN	-1.74	資産曲線の直線らしさ	0.47
1取引あたりの95%範囲	-34.8 ～ -1.0	上位5取引が総利益に…	21%
上位5取引を除いた純益	-10,645	最高値を更新できない…	251日
最大の落ち込みから戻…	戻っていない	勝ち越した月	94%（18か月）

過剰最適化の診断：パラメーターを動かしたときの崩れ方

足す間隔 × ロットの倍率（純益 / 含み損込みの最大落込み%）

間隔\倍率	×1.3	×1.6	×2.0
10 pips	2,011 落込み 32%	-9,992 落込み 100%・2018年に資金切れ	-9,949 落込み 100%・2017年に資金切れ
15 pips	1,513 落込み 33%	-9,990 ★ 落込み 100%・2018年に資金切れ	-9,976 落込み 100%・2017年に資金切れ
20 pips	1,322 落込み 33%	-9,996 落込み 100%・2018年に資金切れ	-9,944 落込み 100%・2017年に資金切れ

★ = ご提示の設定。赤 = 損失か落込み60%以上、黄 = 落込み30%以上、緑 = それ未満

その他のパラメーター

設定	純益	PF	最大落込み	取引数	動いた期間
利確 5pips（基準 8）	7,316	2.30	23%	4,386	最後まで
利確 12pips（基準 8）	-9,990	0.30	100%	599	2018年1月に資金切れ
RSI 20/80（基準 25/75）	4,998	2.95	25%	1,624	最後まで
RSI 30/70（基準 25/75）	-9,992	0.35	100%	1,206	2018年1月に資金切れ

年ごとの成績（ご提示の設定）

2016	1,794	498回	
2017	387	137回	
2018	-12,171	8回	

読み方

- ・ 9通りのうち、損失か落込み60%以上になった組み合わせは 6 通り。
- ・ 最後まで資金が持ったのは 3通りと、利確 5pips・RSI 20/80 だけです。設定を少し変えるだけで「最後まで持つ」と「資金切れ」が入れ替わるため、どの設定なら将来も持つかを過去のデータから選ぶことはできません。ご提示の設定も、この入れ替わりの境目にあります。
- ・ 負けた年：2018。

約定のズレ：スプレッドを悪くしたときの成績

同じ設定で、スプレッドだけを変えた場合

スプレッド	純益	PF	最大落ち込み	取引数	動いた期間
1.0 pips (基準)	-9,990	0.24	100%	643	2018年1月に資金切れ
2.0 pips (2倍)	-9,993	0.25	100%	639	2018年1月に資金切れ
3.0 pips (3倍)	-9,992	0.25	100%	625	2018年1月に資金切れ

読み方

- ・スプレッドを広げても、証拠金が尽きる時期は基準と同じ 2018年1月です。コストの差より、ナンピンが耐えきれない相場が来るかどうかで結果が決まっています。
- ・「現実に寄せた場合」の頁のスワップは、買い -6・売り 1 ポイント（1ロット・1日）で計算しています（サンプルのため一般的な水準の例。実際のご依頼ではお使いの口座の値を使います）。
- ・早朝・指標発表の前後はスプレッドが数倍に広がります。この形のEAはそのたびに足す・まとめて閉じるので、広がった時間帯の影響を強く受けます。

現実に寄せた場合（スプレッド・滑り・手数料・スワップ）

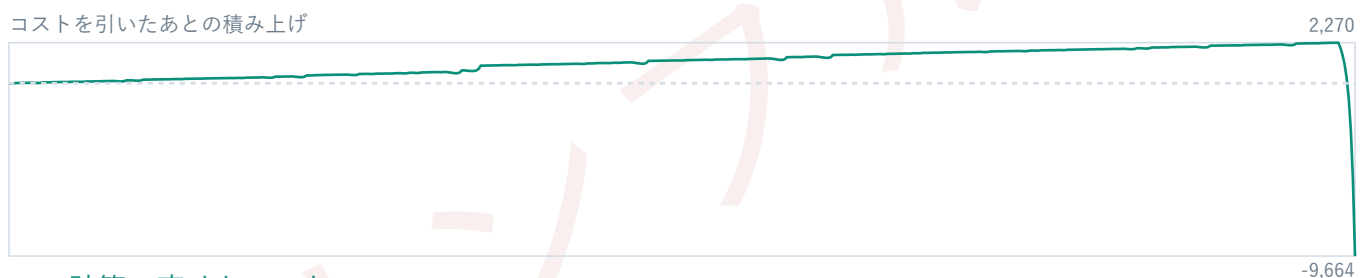
計算の前提

スプレッドの出どころ	配信元（Dukascopy）の実測	平均スプレッド	3.05 ポイント
注文から約定までの遅れ	120 ミリ秒	平均の滑り	0.25 ポイント
手数料（往復・1ロット）	0.00	1ポイントの値段（1ロット）	1.000

内訳

引き直す前の純益	-9,990USD
変動スプレッドの差	+172USD
約定の滑り	-6USD
手数料	+0USD
スワップ	+160USD
外した取引の損益	-0USD（0回）
引き直したあとの純益	-9,664USD
プロフィットファクタ	0.24 → 0.25
最大ドローダウン	12,171 → 11,933USD
元の純益に対する割合	97%

引き直したあとの資産推移



この計算で直せないこと

- ・EAの判断そのものは変わりません（スプレッドを見て見送るEAなら、実際には入らなかった取引があります）
- ・ブローカーごとの値動きの違いまでは再現できません。ここで直しているのはコストです
- ・損切り・利確の約定は、テストの時点で実ティックを使っているため二重には引いていません

EAの性格と、場面ごとの成績

取引の形

売買の偏り	買い 49% / 売り 51%	保有時間（中央）	89分
よく入る時刻	17時台、16時台、10時台	レポートの時刻のずれ	GMT+2

性格

逆張り（直前の動きと逆向きに入っている）

場面別: 時間帯（UTC）

区分	取引数	勝率	1取引あたり	合計
夜間	34	71%	6	208
NY	310	66%	-5	-1,407
ロンドン	217	61%	-29	-6,322
東京	82	70%	-30	-2,469

場面別: 曜日

区分	取引数	勝率	1取引あたり	合計
水	139	65%	5	638
木	129	67%	4	553
金	135	69%	0	41
月	108	68%	-37	-4,038
火	132	57%	-54	-7,184

場面別: 値動きの荒さ（ATR相当）

区分	取引数	勝率	1取引あたり	合計
不明	5	80%	25	125
荒さ やや大きい	159	64%	3	535
荒さ 大きい（上位25%）	160	68%	2	283
荒さ やや小さい	159	68%	1	89
荒さ 小さい（下位25%）	160	61%	-69	-11,021

改良の案

・入るときのスプレッド: スプレッド 小さい（下位25%） … 取引264回（全体の41%）、1取引あたり -16 → 2

※ 条件を足すほど過去に合わせ込みやすくなります。別の期間でも同じ傾向が出るか確かめてから採用してください。

実運用で気をつけるところ

- ・週末をまたぐ持ち越しが5%あります。窓開けと3日分のスワップが実運用では効きます。
- ・スプレッドが開いている場面（5.0ポイント以上）での取引が利益に189ぶん寄与しています。実際にはその値段で約定しないことがあります。

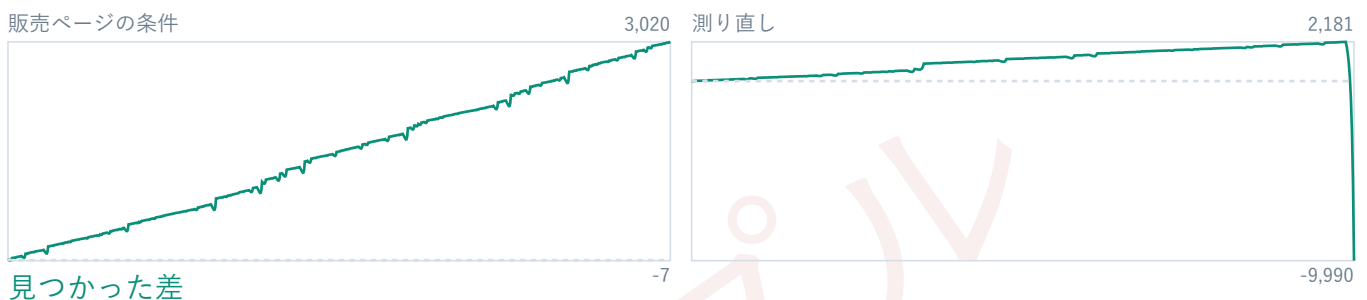
販売ページの成績と、同じEAを条件をそろえて測り直した成績

サンプルでは、販売ページによくある見せ方（成績の良かった3年だけ・スプレッドを極端に狭く）で同じEAを測り、それを「販売ページの成績」の代わりにしています。実際のご依頼では、販売ページや公開口座に載っている数字・条件をそのまま書き写して比べます。

比べ

項目	販売ページの条件	条件をそろえた測り直し
期間	2019-01-01 ~ 2021-12-31	2016-01-01 ~ 2018-01-15
スプレッド	0.2 pips	1.0 pips
純益	3,020	-9,990
PF	3.12	0.24
最大落ち込み（含み損込み）	8.5%	99.9%
勝率（まとめて決済した回）	100.0%	99.7%

資産推移（左 = 販売ページの条件、右 = 2016-01-04 から・実際に近いスプレッド）



見つけた差

- ・期間を良い3年に絞り、スプレッドを狭くすると、純益 3,020・最大の落ち込み 8% の「勝てるEA」に見えます。同じEAを 2016 年から動かすと、2018 年 1 月 15 日に証拠金が尽きています。
- ・よい時期だけを切り出した成績は、そのEAが大きく負ける相場を含んでいないことがあります。販売ページの期間がいつからいつまでかは、必ず確かめてください。
- ・スプレッドを狭く測ると、細かく何度も利確する形のEAほど成績が良く見えます。
- ・勝率が高いことは、この形のEAでは安全の証拠になりません。負けるときは、それまでの勝ちをまとめて失う大きさになります。

別の通貨ペア（USDJPY・同じ設定・同じ期間）

通貨ペア	純益	PF	最大落ち込み	取引数	動いた期間
EURUSD	-9,990	0.24	100%	643	2018年1月に資金切れ
USDJPY	-10,026	0.04	100%	79	2016年6月に資金切れ

- ・USDJPY では 2016 年 6 月に証拠金が尽きています。通貨ペアを変えても、同じ形で崩れます。

内訳と、このレポートの照合

月別の成績

年×月の損益 (USD)

	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
2016												
2017												
2018												

数字のまとめ

総利益	3,119	総損失	-13,109
勝ち / 負け	419 / 224	最大の勝ち / 負け	198 / -4,398
最大連勝 / 連敗	13 / 8	総ロット	24.73

このレポートの照合

照合ID	EAC-281A957E-2609
内容の合言葉 (SHA-256 先頭16桁)	3eb7d361b81e7417
発行	2026-09-20 12:44
発行元	TeamREI / tickbt EA検証

照合ページ: <https://fxbo-mt4.com/verify/EAC-281A957E-2609>

PDFの数字を書き換えると、この合言葉と一致なくなります。照合ページでは、発行時の数字がそのまま表示されます。

注意

- ・過去のデータでの検証結果です。将来の成績を約束するものではありません。
- ・スプレッド・約定の滑り・スワップ・ブローカーの違いにより、実際の成績は変わります。
- ・検査の数字は弱点の在りかを示すもので、良い数字が出れば勝てるという意味ではありません。
- ・このレポートは、TeamREIのtickbtが作成したものです。

