

この度は、当ブログからの EA 購入ありがとうございます。

この特典は、より安心して自動売買運用するために、ブログ記事よりさらに詳しい EA の分析・検証を行ったデータをまとめたレポートです。

このレポートを参照することで、AI Rig 03 のメリットを最大限引き出し、あなたの FX 運用の助けとしていただけると幸いです。

## 目次

### 1 章：TDS を使用したスプレッド別のバックテスト比較

- ・スプレッド補正の基準値

#### 1.スプレッド補正無しバックテスト

##### 1-1.テストレポート

##### 1-2.年月度別損益額

##### 1-3.年月度別獲得 pips

#### 2.XM での運用を想定したバックテスト

##### 2-1.テストレポート

##### 2-2.年月度別損益額

##### 2-3.年月度別損益 pips

#### 3.TariTali 経由での運用を想定したバックテスト

##### 3-1.テストレポート

##### 3-2.年月度別獲得額

##### 3-3.年月度別獲得 pips

#### 4.比較表

### 2 章：全ポジション損切り時の詳細検証

#### 1.全損時のポジション推移

#### 2.当時のチャート推移

#### 3.ビジュアルモードでのバックテスト比較

##### 3-1.全損時バックテスト

##### 3-2.急落時バックテスト

##### 3-3.比較表

#### 4.損切りをするか保有するかの考察

### 3 章：AI Rig 03 の運用方法

#### 1.AI Rig 03 の資金管理

#### 2.AI Rig 03 のデメリットと対策

##### 2-1.AI Rig 03 のデメリット

##### 2-2.対策

- ・最後に

# Ⅰ章：TDS を使用したスプレッド別のバックテスト比較

EA 運用におけるスプレッドの違いは、純利益に大きな差をもたらします。

だからこそ、運用口座別にスプレッド補正を行ったバックテストには大きな意味があります。

当レポートでのバックテストは次の 3 通りで行っています。

- 1.スプレッド補正無しバックテスト
- 2.海外口座（XM）での運用を想定したバックテスト
- 3.XM でキャッシュバックサイト経由を想定したバックテスト

※海外口座での FX 運用は、必ずキャッシュバックサイトを経由してください。  
当特典では TariTali 経由を想定しています。

## ・スプレッド補正の基準値

スプレッド補正には、TariTali の XM のページに記載された実質取引コストの表を参照しています

。

XM で TariTali を 経由しない場合は、平均スプレッドを、TariTali を 経由する場合は実質取引コストを運用スプレッドとして採用し、TDS で補正を行います。

### ▼スタンダード・マイクロ口座の実質取引コスト

| 通貨ペア          | 平均スプレッド | キャッシュバック※ | ボーナス<br>(XMP) | 実質取引コスト  |
|---------------|---------|-----------|---------------|----------|
| <b>USDJPY</b> | 1.6pips | 0.9pips   | 0.66pips      | 0.04pips |
| <b>EURJPY</b> | 2.3pips |           |               | 0.74pips |
| <b>GBPJPY</b> | 3.6pips |           |               | 2.04pips |
| <b>AUDJPY</b> | 3.3pips |           |               | 1.74pips |
| <b>EURUSD</b> | 1.7pips |           |               | 0.14pips |
| <b>GBPUSD</b> | 2.1pips |           |               | 0.54pips |

※ オートリポートで適用されるキャッシュバック額

表でのキャッシュバックはオートリベート口座のものとなっていますが、補正は通常キャッシュバック口座での 0.85pips にて行います。

| 通常キャッシュバック口座    |                                      |
|-----------------|--------------------------------------|
| スタンダード口座(STP)   | 8.5USD                               |
| マイクロ口座(STP)     | 8.5USD                               |
| KIWAMI極口座 (STP) | 2.55~12.75USD ( <a href="#">詳細</a> ) |
| ゼロ口座(ECN)       | 4.25USD                              |
| オートリベート口座       |                                      |
| スタンダード口座(STP)   | 9USD                                 |
| マイクロ口座(STP)     | 9USD                                 |
| KIWAMI極口座 (STP) | 2.7~13.5USD ( <a href="#">詳細</a> )   |
| ゼロ口座(ECN)       | 4.5USD                               |

※10万通貨あたりのリベート額。1万通貨、1000通貨の場合はリベート額も応分に縮小する。

# 1.スプレッド補正無しバックテスト

補正無しのバックテストでの EURJPY のスプレッドはデューカスコピーの値を使用し、中央値は 1.2pips となっています。

※レポート作成時のデータ

## スプレッド

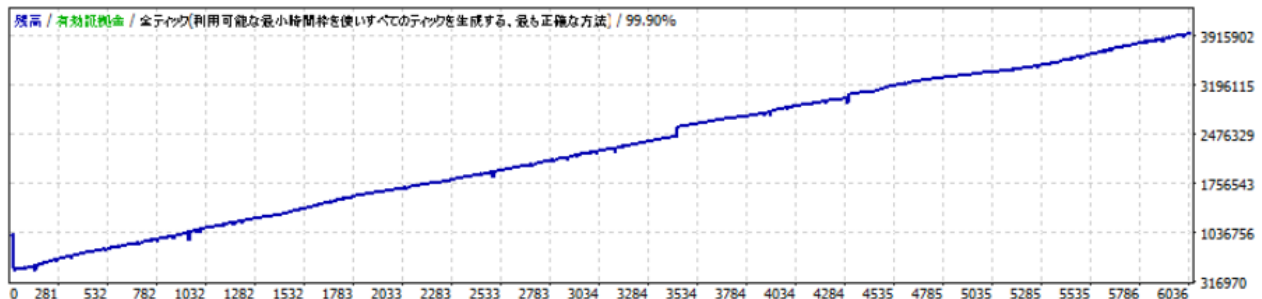
スプレッド・ウィジェットでは、主要通貨ペアのスプレッド実績値をご確認いただけます。

|   | 通貨ペア    | 🔍 | レンジ       | 中央値 | 期間                      |
|---|---------|---|-----------|-----|-------------------------|
| 📉 | AUD/JPY |   | 0.7 - 1.1 | 0.9 | 2023/04/29 - 2023/05/05 |
| 📉 | CAD/JPY |   | 1.0 - 1.6 | 1.3 | 2023/04/29 - 2023/05/05 |
| 📉 | CHF/JPY |   | 1.7 - 2.7 | 2.2 | 2023/04/29 - 2023/05/05 |
| 📉 | EUR/JPY |   | 1.0 - 1.4 | 1.2 | 2023/04/29 - 2023/05/05 |
| 📉 | EUR/USD |   | 0.2 - 0.4 | 0.3 | 2023/04/29 - 2023/05/05 |
| 📉 | GBP/JPY |   | 1.9 - 2.5 | 2.2 | 2023/04/29 - 2023/05/05 |
| 📉 | GBP/USD |   | 0.8 - 1.2 | 1.0 | 2023/04/29 - 2023/05/05 |
| 📉 | NZD/JPY |   | 0.7 - 1.5 | 1.1 | 2023/04/29 - 2023/05/05 |
| 📉 | TRY/JPY |   | 0.7 - 8.4 | 4.5 | 2023/04/29 - 2023/05/05 |
| 📉 | USD/JPY |   | 0.4 - 0.8 | 0.6 | 2023/04/29 - 2023/05/05 |
| 📉 | ZAR/JPY |   | 0.3 - 0.7 | 0.5 | 2023/04/29 - 2023/05/05 |

## 1-1. テストレポート

### Strategy Tester Report AI Rig 03 -EURJPY M15- 1F81C9C76 FXTF-Live (Build 1380)

|                     |   |              |  |
|---------------------|---|--------------|--|
| 通貨ペア                | EURJPY-cd (Euro vs Japanese Yen)  |              |  |
| 期間                  | 15分足(M15) 2010.01.04 00:00 - 2023.04.06 23:45 (2010.01.01 - 2023.04.07)   |              |  |
| モデル                 | 全ティック (利用可能な最小時間枠による最も正確な方法)  |              |  |
| パラメーター              | MagicNumber=1032032; Lots=0.1; MaxPosition=8; Slippage=0; TakeProfit=5; StopLoss=200; NoTradeABalance=0; MaxSpread=5; YearEnd_NoOpen=true; YearEnd_NoOpen_Month=12; YearEnd_NoOpen_Day=24; NewYear_NoOpen=true; NewYear_NoOpen_Month=1; NewYear_NoOpen_Day=5; |              |  |
| テストバ<br>ー数          | 330817  | モデルティック数     | 385993551 モデリング品質 99.90%                       |
| 不整合チ<br>ャートエ<br>ラー  | 0   |              |  |
| 初期証拠<br>金           | 1000000.00  | スプレッド        | 変動   |
| 純益                  | 2948312.51  | 総利益          | 5837506.86 総損失 -2889194.35                     |
| プロフィ<br>ットファ<br>クター | 2.02  | 期待利得         | 489.10   |
| 絶対ドロ<br>ーダウン        | 839194.53   | 最大ドローダウン     | 849228.07 (84.08%) 相対ドローダウン 84.08% (849228.07) |
| 総取引数                | 6028  | 売りポジション(勝率%) | 0 (0.00%) 買いポジション(勝率%) 6028 (96.95%)           |
|                     |   | 勝率(%)        | 5844 (96.95%) 負率(%) 184 (3.05%)                |
|                     | 最大  | 勝トレード        | 66380.59 敗トレード -120157.62                      |
|                     | 平均  | 勝トレード        | 998.89 敗トレード -15702.14                         |
|                     | 最大  | 連勝(金額)       | 281 (272335.95) 連敗(金額) 8 (-517176.34)          |
|                     | 最大  | 連勝(トレード数)    | 272335.95 (281) 連敗(トレード数) -517176.34 (8)       |
|                     | 平均  | 連勝           | 38 連敗 1  |



- ・テスト期間：2010年1月1日～2023年4月7日
- ・初期証拠金：100万円
- ・Lot：0.1（1万通貨）
- ・純益：294万8312円
- ・総利益：583万7506円
- ・総損失：-288万9194円
- ・プロフィットファクター：2.02
- ・期待損益（1トレードの利益）：489円
- ・絶対ドローダウン：83万9194円
- ・最大ドローダウン：84万9228円
- ・相対ドローダウン：84.08%

## I-2.年月度別損益額

MONTHLY PERFORMANCE (\$)

| Year | Jan      | Feb        | Mar      | Apr       | May      | Jun      | Jul      | Aug      | Sep      | Oct      | Nov      | Dec      | YTD        |
|------|----------|------------|----------|-----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|------------|
| 2023 | 15163.53 | 21519.99   | 27877.62 | 56.47     | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 64617.61   |
| 2022 | 10125.87 | 16307.65   | 44239.4  | 33151.74  | 53214.7  | 50377.64 | 31932.36 | 47365.27 | 35677.05 | 26632.93 | 22003.54 | 25220.6  | 396248.75  |
| 2021 | 12438.83 | 14258.23   | 11258.83 | 17762.93  | 16913.5  | 14600.57 | 6888.85  | 4950.01  | 15738.82 | 27627.63 | 1150.58  | 9435.37  | 153024.15  |
| 2020 | 6502.35  | 5455.33    | 75605.87 | 11691.19  | 15606.47 | 11225.88 | 20426.5  | 26997.03 | 11084.72 | 17944.69 | 18437.05 | 15268.82 | 236245.9   |
| 2019 | 0        | 19609.43   | 9936.48  | 11522.94  | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 68593.43 | 10814.11 | 12228.83 | 132705.22  |
| 2018 | 23303.54 | 5001.17    | 0        | 24734.82  | 0        | 38553    | 18189.41 | 13867.09 | 20403.52 | 15828.23 | 22854.11 | 21242.93 | 203977.82  |
| 2017 | 24667.64 | 0          | 15837.68 | 142046.52 | 34061.18 | 26448.83 | 22552.93 | 19600.59 | 23204.11 | 16197.63 | 12943.54 | 14043.53 | 351604.18  |
| 2016 | 7258.86  | 18641.17   | 22716.49 | 22756.49  | 27497.64 | 6033.57  | 24362.94 | 9081.78  | 10560.02 | 19476.45 | 39238.81 | 27587.63 | 235211.85  |
| 2015 | 34998.81 | 22655.28   | 17778.84 | 35731.76  | 33336.45 | 19388.81 | 46352.33 | 22767.64 | 22448.84 | 13552.94 | 0        | 35628.88 | 304640.58  |
| 2014 | 22383.52 | 27859.43   | 11517.08 | 20224.69  | 13472.36 | 5640     | 0        | 12856.53 | 12469.41 | 14378.86 | 31057.04 | 19910.57 | 191769.49  |
| 2013 | 43682.93 | 41262.33   | 36317.63 | 42200     | 28113.53 | 30088.82 | 28658.23 | 24529.43 | 30019.99 | 24158.22 | 24877.07 | 12038.82 | 365947     |
| 2012 | 13902.41 | 29405.31   | 25831.78 | 14299.43  | 12195.29 | 28952.37 | 2425.29  | 24710.06 | 15778.22 | 17802.36 | 23832.94 | 14807.65 | 223943.11  |
| 2011 | 22003.56 | 25334.09   | 39084.68 | 41438.81  | 18404.71 | 20384.72 | 21030.62 | 39345.86 | 0        | 31817.15 | 275.29   | 12831.8  | 271951.29  |
| 2010 | 10033.53 | -510926.33 | 33605.89 | 21124.11  | 47258.82 | 45561.17 | 42900.58 | 11442.36 | 50359.99 | 18717.04 | 31894.69 | 14451.79 | -183576.36 |

ところどころに利益額0の月があります。

特に2019年5月から9月までの5ヵ月間、全く利益が上がっていません。

このEAは買いポジションのみの運用となっておりますので、逆行して戻ってこない場合、ナンピンポジションを抱えたままこのような事態になることがあります。

**だからこそ、プラススワップでの運用が重要となります。**

EURJPYの買いスワップがマイナスとなった場合、含み損が解消した時点で速やかに運用を停止してください。

何もしていないのに資金が減っていくストレスは想像を絶します。

※損益単位は仕様上\$となっておりますが、実際は円で表示されています。

## I-3.年月度別獲得 pips

MONTHLY PERFORMANCE (PIPS)

| Year | Jan   | Feb     | Mar   | Apr    | May   | Jun   | Jul   | Aug   | Sep   | Oct   | Nov   | Dec   | YTD     |
|------|-------|---------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|---------|
| 2023 | 143.8 | 204.1   | 261.8 | -2.7   | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 607     |
| 2022 | 99.3  | 135     | 432.6 | 316.5  | 521.7 | 497.9 | 291.9 | 461.9 | 352.2 | 259.8 | 201.1 | 228.7 | 3798.6  |
| 2021 | 115.9 | 135.4   | 93    | 171.1  | 161.3 | 133.6 | 27.1  | 27.3  | 137.8 | 270.4 | 10.2  | 4.9   | 1288    |
| 2020 | 59.8  | 9.5     | 743   | 92.1   | 141.7 | 110.3 | 145.5 | 265.4 | 89.3  | 169   | 168.7 | 144.2 | 2138.5  |
| 2019 | 0     | 141.9   | 85    | 97.6   | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 80    | 99    | 113.8 | 617.3   |
| 2018 | 225.2 | 47.4    | 0     | 92.6   | 0     | 312.4 | 172.1 | 100.8 | 196.2 | 151.1 | 208.3 | 205.9 | 1712    |
| 2017 | 240.8 | 0       | 108.1 | 1350.6 | 338   | 256   | 219   | 183.6 | 222.9 | 156.1 | 110.5 | 132.6 | 3318.2  |
| 2016 | 30.8  | 183.8   | 201.7 | 202.1  | 269.1 | 8.1   | 214.9 | 64.7  | 83.4  | 180.4 | 383.9 | 270   | 2092.9  |
| 2015 | 341.5 | 214.8   | 136   | 342.3  | 330.1 | 185.4 | 458.3 | 221.8 | 182.7 | 129   | 0     | 270.1 | 2812    |
| 2014 | 216   | 257.7   | 88.4  | 191.8  | 118.4 | 56.4  | 0     | 58.7  | 114.9 | 90.9  | 306   | 186.7 | 1685.9  |
| 2013 | 430.3 | 407.4   | 357.3 | 399.8  | 273.3 | 292.4 | 279.4 | 224.4 | 289.1 | 234.4 | 233.1 | 111.9 | 3532.8  |
| 2012 | 67.2  | 282.3   | 243.3 | 111    | 110.2 | 262.1 | 23.6  | 158.3 | 150.6 | 161.7 | 220.7 | 142.2 | 1933.2  |
| 2011 | 178.9 | 244.2   | 380.4 | 405.9  | 151.4 | 171.2 | 175.7 | 380.4 | 0     | 180.4 | 2.1   | 68.9  | 2339.5  |
| 2010 | 92.5  | -5272.5 | 323   | 191    | 453   | 453   | 405.5 | 87    | 492.5 | 182.6 | 308.5 | 107.3 | -2176.6 |

初年度は大きくマイナスとなっていますが、他の年は月単位でマイナスになっているところはあります。

2023年4月の獲得 pips がマイナスなのは、テスト終了時の保有ポジションが抱えていた含み損になります。



## 2.XMでの運用を想定したバックテスト

XMでの運用を想定するにあたり、スプレッド補正無しのバックテストを基準として、スプレッドの加算をTDSのティックデータ設定で行っていきます。

実質取引コストの表を参照すると、XMでのEURJPYの平均スプレッドは2.3pipsです。スプレッド補正無しのデューカスコピーのスプレッドは1.2pipsでその差1.1pipsとなります。

従って、XMでの運用を想定したバックテストでは、1.1pips=11ポイントをスプレッド加算値として入力します。

ティックデータ設定

基本 スプレッド スリッページ エキゾチックパー 高度な設定 専門的な設定 証拠金 その他

スプレッドタイプ  
☐ 修正された ☒ 変動

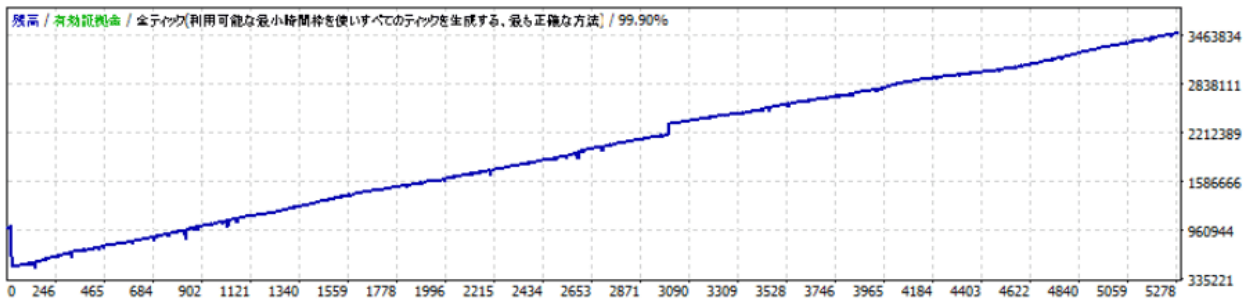
|         |   |         |    |
|---------|---|---------|----|
| スプレッド乗数 | 1 | スプレッド加算 | 11 |
| 最小スプレッド | 1 | 最大スプレッド | 0  |

Tick Data Manager 初期設定に戻す OK キャンセル

## 2-1. テストレポート

### Strategy Tester Report AI Rig 03 -EURJPY M15- 1F81C9C76 FXTF-Live (Build 1380)

|                    |   |              |  |
|--------------------|---|--------------|--|
| 通貨ペア               | EURJPY-cd (Euro vs Japanese Yen)  |              |  |
| 期間                 | 15分足(M15) 2010.01.04 00:00 - 2023.04.06 23:45 (2010.01.01 - 2023.04.07)   |              |  |
| モデル                | 全ティック (利用可能な最小時間枠による最も正確な方法)  |              |  |
| パラメーター             | MagicNumber=1032032; Lots=0.1; MaxPosition=8; Slippage=0; TakeProfit=5; StopLoss=200; NoTradeABalance=0; MaxSpread=5; YearEnd_NoOpen=true; YearEnd_NoOpen_Month=12; YearEnd_NoOpen_Day=24; NewYear_NoOpen=true; NewYear_NoOpen_Month=1; NewYear_NoOpen_Day=5; |              |  |
| テストバ<br>ー数         | 330817  | モデルティック数     | 385993551 モデリング品質 99.90%                       |
| 不整合チ<br>ャートエ<br>ラー | 0   |              |  |
| 初期証拠<br>金          | 1000000.00  | スプレッド        | 変動   |
| 純益                 | 2491412.11  | 総利益          | 5426493.67 総損失 -2935081.56                     |
| プロフィ<br>ットファ<br>クタ | 1.85  | 期待利得         | 472.66   |
| 絶対ドロ<br>ーダウン       | 843636.60   | 最大ドローダウン     | 852133.43 (84.50%) 相対ドローダウン 84.50% (852133.43) |
| 総取引数               | 5271  | 売りポジション(勝率%) | 0 (0.00%) 買いポジション(勝率%) 5271 (96.49%)           |
|                    |   | 勝率(%)        | 5086 (96.49%) 負率(%) 185 (3.51%)                |
|                    | 最大  | 勝トレード        | 66574.85 敗トレード -120078.15                      |
|                    | 平均  | 勝トレード        | 1066.95 敗トレード -15865.31                        |
|                    | 最大  | 連勝(金額)       | 188 (228799.02) 連敗(金額) 8 (-516723.77)          |
|                    | 最大  | 連勝(トレード数)    | 228799.02 (188) 連敗(トレード数) -516723.77 (8)       |
|                    | 平均  | 連勝           | 33 連敗 1  |



- ・テスト期間：2010年1月1日～2023年4月7日
- ・初期証拠金：100万円
- ・Lot:0.1 (1万通貨)
- ・純益：249万1412円
- ・総利益：526万6493円
- ・総損失：-293万5081円
- ・プロフィットファクター：1.85
- ・期待損益 (1トレードの利益)：472円
- ・絶対ドローダウン：84万3636円
- ・最大ドローダウン：85万2133円
- ・相対ドローダウン：84.50%

## 2-2.年月度別獲得額

MONTHLY PERFORMANCE (\$)

| Year | Jan      | Feb        | Mar      | Apr       | May      | Jun      | Jul      | Aug      | Sep      | Oct      | Nov      | Dec      | YTD        |
|------|----------|------------|----------|-----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|------------|
| 2023 | 14079.09 | 18946.2    | 27165.27 | -482.88   | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 59707.68   |
| 2022 | 8932.26  | 16121.52   | 40641.65 | 32060.73  | 44580.75 | 50936.81 | 30026.36 | 44038.76 | 31461.96 | 23991.66 | 16935.31 | 24287.28 | 364015.05  |
| 2021 | 11371.36 | 6681.06    | 6129.87  | 12136.5   | 13151.64 | 11901.05 | 1050     | 0        | 17393.11 | 19138.48 | 1084.84  | 9727.22  | 109765.13  |
| 2020 | 5889.39  | 5522.31    | 68598.47 | 11142.13  | 13743.33 | 8177.42  | 19288.22 | 20804.52 | 9875.01  | 7138.78  | 12124.4  | 11616.51 | 193920.49  |
| 2019 | 0        | 17506.23   | 8023.34  | 14887.27  | 982.27   | 0        | 11734.34 | 0        | 19527.84 | 12679.09 | 917.12   | 12626.98 | 98884.48   |
| 2018 | 18879.1  | 3979.69    | 0        | 23489.7   | 0        | 36631.58 | 16351.36 | 12600.63 | 19199.08 | 9901.36  | 19120.14 | 16261.66 | 176414.3   |
| 2017 | 20946.81 | 0          | 13849.12 | 141734.46 | 25279.7  | 25741.07 | 20656.81 | 20733.33 | 20166.2  | 14634.22 | 12445.31 | 14229.09 | 330416.12  |
| 2016 | 7705.19  | 1550       | 20502.77 | 21296.98  | 28281.66 | 5953.98  | 21804.1  | 8066.98  | 10582.44 | 17193.31 | 37518.77 | 23206.8  | 203662.98  |
| 2015 | 32806.5  | 22571.65   | 17605.17 | 31823.02  | 28229.38 | 20671.34 | 35629.37 | 18791.36 | 21532.59 | 14394.24 | 0        | 34460.07 | 278514.69  |
| 2014 | 20249.08 | 26212.43   | 10434.42 | 12406.2   | 11065.61 | 3910     | 0        | 8751.29  | 8473.94  | 10522.97 | 21909.37 | 19698.46 | 153633.77  |
| 2013 | 36154.23 | 39909.37   | 24904.22 | 37299.84  | 27156.51 | 29728.78 | 25644.24 | 21135.01 | 26953.62 | 20691.35 | 20188.19 | 12586.51 | 322351.87  |
| 2012 | 12896.75 | 25713.65   | 23640.77 | 12833.81  | 1602.27  | 28430.98 | 2437.42  | 22887.18 | 14114.23 | 15251.06 | 20090.45 | 12696.82 | 192595.39  |
| 2011 | 17297.76 | 22644.22   | 35938.76 | 38846.5   | 16901.21 | 15898.67 | 18923.51 | 35058.46 | 0        | 30476.34 | 757.42   | 13525.64 | 246268.49  |
| 2010 | 8496.82  | -510743.77 | 31121.06 | 21207.56  | 45174.99 | 41239.69 | 36941.81 | 2254.54  | 25482.52 | 16204.53 | 30006.19 | 13873.21 | -238740.85 |

## 2-3.年月度別獲得 pips

MONTHLY PERFORMANCE (PIPS)

| Year | Jan   | Feb   | Mar   | Apr    | May   | Jun   | Jul   | Aug   | Sep   | Oct   | Nov   | Dec   | YTD     |
|------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|---------|
| 2023 | 132.7 | 178   | 252.1 | -8.2   | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 554.6   |
| 2022 | 87.3  | 130.2 | 399   | 305.1  | 430.3 | 503.3 | 267.9 | 429.6 | 309.9 | 232.5 | 149.8 | 218.6 | 3463.5  |
| 2021 | 103.6 | 54    | 37.7  | 112.6  | 124.1 | 106.2 | 10.5  | 0     | 67.4  | 177.9 | 9.5   | 4.9   | 808.4   |
| 2020 | 53.5  | 8.7   | 672.5 | 85.8   | 122.6 | 81.1  | 132.2 | 204   | 76.5  | 60.6  | 93.6  | 107.4 | 1698.5  |
| 2019 | 0     | 119.1 | 65.4  | 124.6  | 7.8   | 0     | 21.6  | 0     | 63.8  | 118.7 | 5.8   | 99.3  | 626.1   |
| 2018 | 180.7 | 37.1  | 0     | 75.1   | 0     | 290.8 | 153.4 | 86.9  | 183.9 | 88.9  | 170.3 | 155.2 | 1422.3  |
| 2017 | 203.4 | 0     | 85.9  | 1345.2 | 250.1 | 244.6 | 200.5 | 192.5 | 190.2 | 139.6 | 104.9 | 134.2 | 3091.1  |
| 2016 | 33.9  | 15.5  | 27.7  | 186    | 275.4 | 5.6   | 187.7 | 53.7  | 82.9  | 157.1 | 364.4 | 226   | 1615.9  |
| 2015 | 319.3 | 218.3 | 132.9 | 300.7  | 276.9 | 196.6 | 350.9 | 177.8 | 171.5 | 137.2 | 0     | 255.6 | 2537.7  |
| 2014 | 194.4 | 239.2 | 76.7  | 112.6  | 93.8  | 39.1  | 0     | 9.3   | 75.3  | 19.6  | 213.7 | 183.5 | 1257.2  |
| 2013 | 354.8 | 393.7 | 242.3 | 349.4  | 262.8 | 286.5 | 249.7 | 189.1 | 257.4 | 196.8 | 185.7 | 117.1 | 3085.3  |
| 2012 | 54.8  | 245   | 220.9 | 95.3   | 14    | 203.4 | 23.7  | 136.5 | 134.4 | 139.7 | 182.7 | 120.9 | 1571.3  |
| 2011 | 130.5 | 219.7 | 348.6 | 379.7  | 135.3 | 124.6 | 153.5 | 337.1 | 0     | 159.8 | 6.9   | 73.9  | 2069.6  |
| 2010 | 78.9  | -5276 | 298.4 | 190.5  | 429.5 | 409.7 | 341.1 | 18.5  | 142.9 | 158   | 288.6 | 100.3 | -2819.6 |

### 3.TariTali 経由での運用を想定したバックテスト

実質取引コストの表を参照すると、XM で TariTali を経由した場合の EURJPY の実質スプレッドは 0.74pips です。

表でのキャッシュバックはオートリベート口座の 0.9pips のものとなっていますが、通常キャッシュバック口座では 0.85pips なので、実質スプレッドは  $0.74 + (0.9 - 0.85) = \text{約 } 0.8\text{pips}$  となります。

スプレッド補正無しのデューカスコピーのスプレッドは 1.2pips で、その差 -0.4pips となります。

従って、TariTali 経由での運用を想定したバックテストでは、 $-0.4\text{pips} = -4$  ポイントをスプレッド加算値として入力します。

ティックデータ設定

基本 スプレッド スリッページ エキゾチックパー 高度な設定 専門的な設定 証拠金 その他

スプレッドタイプ  
☐ 修正された ☒ 変動

スプレッド乗数 1 スプレッド加算 -4

最小スプレッド 1 最大スプレッド 0

Tick Data Manager 初期設定に戻す OK キャンセル

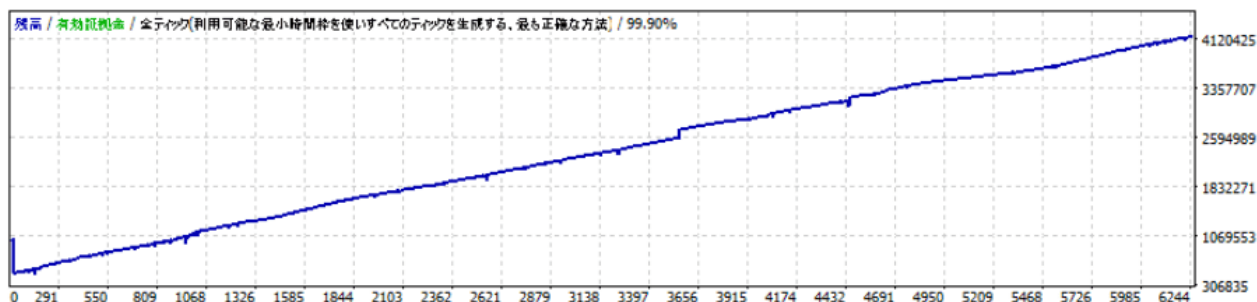
### 3-1. テストレポート

## Strategy Tester Report

### AI Rig 03 -EURJPY M15- 1F81C9C76

FXTF-Live (Build 1380)

|                     |   |                 |  |
|---------------------|---|-----------------|--|
| 通貨ペア                | EURJPY-cd (Euro vs Japanese Yen)  |                 |  |
| 期間                  | 15分足(M15) 2010.01.04 00:00 - 2023.04.06 23:45 (2010.01.01 - 2023.04.07)   |                 |  |
| モデル                 | 全ティック (利用可能な最小時間枠による最も正確な方法)  |                 |  |
| パラメーター              | MagicNumber=1032032; Lots=0.1; MaxPosition=8; Slippage=0; TakeProfit=5; StopLoss=200; NoTradeABalance=0; MaxSpread=5; YearEnd_NoOpen=true; YearEnd_NoOpen_Month=12; YearEnd_NoOpen_Day=24; NewYear_NoOpen=true; NewYear_NoOpen_Month=1; NewYear_NoOpen_Day=5; |                 |  |
| テストバ<br>ー数          | 330817  | モデルティック数        | 385993551 モデリング品質 99.90%                       |
| 不整合チ<br>ャートエ<br>ラー  | 0   |                 |  |
| 初期証拠<br>金           | 1000000.00  | スプレッド           | 変動   |
| 純益                  | 3155040.77  | 総利益             | 6002450.19 総損失 -2847409.42                     |
| プロフィ<br>ットファ<br>クター | 2.11  | 期待利得            | 505.94   |
| 絶対ドロ<br>ーダウン        | 838926.99   | 最大ドローダウン        | 849319.24 (84.06%) 相対ドローダウン 84.06% (849319.24) |
| 総取引数                | 6236  | 売りポジション(勝率%)    | 0 (0.00%) 買いポジション(勝率%) 6236 (97.08%)           |
|                     |   | 勝率(%)           | 6054 (97.08%) 負率(%) 182 (2.92%)                |
|                     | 最大 勝トレード  | 66425.37        | 敗トレード -120067.13                               |
|                     | 平均 勝トレード  | 991.49          | 敗トレード -15645.11                                |
|                     | 最大 連勝(金額)   | 292 (276715.54) | 連敗(金額) 8 (-516658.17)                          |
|                     | 最大 連勝(トレード数)  | 276715.54 (292) | 連敗(トレード数) -516658.17 (8)                       |
|                     | 平均 連勝   | 40              | 連敗 1   |



- テスト期間：2010年1月1日～2023年4月7日
- 初期証拠金：100万円
- Lot:0.1 (1万通貨)
- 純益：315万5040円
- 総利益：600万2450円
- 総損失：-284万7409円
- プロフィットファクター：2.11
- 期待損益 (1トレードの利益)：505円
- 絶対ドローダウン：83万8926円
- 最大ドローダウン：84万9319円
- 相対ドローダウン：84.06%

### 3-2.年月度別獲得額

MONTHLY PERFORMANCE (\$)

| Year | Jan      | Feb        | Mar      | Apr       | May      | Jun      | Jul      | Aug      | Sep      | Oct      | Nov      | Dec      | YTD        |
|------|----------|------------|----------|-----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|------------|
| 2023 | 16052.25 | 24040.69   | 27599.89 | 268.43    | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 67961.26   |
| 2022 | 10773.07 | 21927.5    | 45875.32 | 33569.13  | 55442.99 | 52889.18 | 33572.88 | 49258.38 | 36073.81 | 28746.88 | 22552.93 | 24216.75 | 414898.82  |
| 2021 | 13409.94 | 15734.56   | 12220.62 | 18586.88  | 18422.26 | 15196.07 | 7242     | 5767.5   | 16599.87 | 31366.88 | 1225.38  | 9803.17  | 165575.13  |
| 2020 | 6521.5   | 5610.43    | 77413.75 | 12364.43  | 17499.12 | 12363.06 | 21731.86 | 27873.83 | 11753.69 | 18623    | 19861.44 | 15809.94 | 247426.05  |
| 2019 | 0        | 20278.07   | 10559.12 | 12927.56  | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 71923.85 | 11947.63 | 14239.93 | 141876.16  |
| 2018 | 25112.24 | 5200.75    | 0        | 26711.9   | 0        | 40460.98 | 18675.32 | 14365.86 | 21772.25 | 16474.55 | 22938.32 | 21266.88 | 212979.05  |
| 2017 | 26459.19 | 0          | 17176.55 | 142792.55 | 36498.44 | 26529.94 | 23669.19 | 20403.75 | 22237.63 | 17209.2  | 14402.93 | 15082.25 | 362461.62  |
| 2016 | 29744.56 | 21030.75   | 23249.81 | 21529.81  | 29029.19 | 5934.99  | 25578.25 | 9567.5   | 11121.36 | 20479.13 | 40157.63 | 28549.19 | 265972.17  |
| 2015 | 36369.94 | 25725.31   | 18941.99 | 37326.81  | 34478.45 | 20659.94 | 48031.51 | 23719.19 | 24331.98 | 14076.88 | 0        | 39594.74 | 323256.74  |
| 2014 | 25412.25 | 30195.99   | 15569.06 | 21773     | 13554.5  | 6090     | 0        | 13542.54 | 13415.31 | 14752.68 | 33203.82 | 20338.38 | 207847.53  |
| 2013 | 44716.88 | 43459.2    | 36829.2  | 43531.37  | 28912.25 | 30759.93 | 30744.57 | 25885.99 | 30020.69 | 26024.57 | 26976.8  | 12369.94 | 380231.39  |
| 2012 | 14505.61 | 30658.37   | 26806.81 | 14796.68  | 12818.37 | 30282.86 | 2627.69  | 26755.49 | 16344.57 | 17572.19 | 25455.25 | 15379.18 | 234003.07  |
| 2011 | 23764.3  | 26635.32   | 40583.02 | 41949.93  | 20735.91 | 21184.37 | 22517.44 | 39850.68 | 0        | 60352.03 | 317.69   | 13679.55 | 311570.24  |
| 2010 | 10392.25 | -512538.17 | 34063.74 | 21720.63  | 49080.61 | 44100.75 | 43386.76 | 10582.87 | 51030.69 | 19503.82 | 32769.95 | 14888.18 | -181017.92 |

### 3-3.年月度別獲得 pips

MONTHLY PERFORMANCE (PIPS)

| Year | Jan   | Feb     | Mar   | Apr    | May   | Jun   | Jul   | Aug   | Sep   | Oct   | Nov   | Dec   | YTD     |
|------|-------|---------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|---------|
| 2023 | 152.4 | 228.9   | 258.4 | -0.7   | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 639     |
| 2022 | 105.7 | 192.2   | 448.6 | 320.8  | 543.6 | 522.8 | 307.3 | 480.4 | 356   | 280.7 | 205.9 | 217.8 | 3981.8  |
| 2021 | 125.3 | 149.9   | 101.9 | 179.1  | 176.1 | 139.1 | 29.1  | 30.6  | 148.4 | 306.9 | 10.9  | 5.3   | 1402.6  |
| 2020 | 59.8  | 9.4     | 760.6 | 98.6   | 160.1 | 121.6 | 156.4 | 274   | 95.2  | 175.4 | 184.4 | 149.3 | 2244.8  |
| 2019 | 0     | 146.6   | 90.7  | 111    | 0     | 0     | 0     | 0     | 0     | 91.1  | 110   | 133.6 | 683     |
| 2018 | 243   | 49.3    | 0     | 106.7  | 0     | 328.8 | 176.6 | 104.4 | 209.6 | 157.3 | 208.4 | 205.9 | 1790    |
| 2017 | 258.5 | 0       | 121   | 1355.5 | 361.6 | 256.5 | 230.6 | 190.5 | 212.9 | 166   | 124.4 | 142.7 | 3420.2  |
| 2016 | 290   | 207.6   | 206.1 | 188.9  | 284.2 | 5.2   | 226   | 68.6  | 88.2  | 189.9 | 392.1 | 279.4 | 2426.2  |
| 2015 | 354.9 | 247.1   | 146.1 | 357.7  | 341.4 | 197.8 | 474.9 | 231.1 | 200   | 134   | 0     | 306.6 | 2991.6  |
| 2014 | 246   | 280.3   | 132   | 206.9  | 119.3 | 60.9  | 0     | 63    | 124   | 92.7  | 327.3 | 191.2 | 1843.6  |
| 2013 | 440.4 | 428.5   | 362.2 | 412.3  | 281   | 298.8 | 300   | 237.2 | 288.7 | 252.8 | 254.2 | 114.9 | 3671    |
| 2012 | 70.6  | 294.4   | 252.5 | 114.8  | 116   | 274.4 | 25.6  | 175.5 | 156   | 158.8 | 235.6 | 147.7 | 2021.9  |
| 2011 | 195   | 256.2   | 395   | 410.7  | 176.9 | 178   | 189.3 | 387   | 0     | 460.7 | 2.5   | 75.2  | 2726.5  |
| 2010 | 95.8  | -5294.6 | 327.1 | 196.9  | 470.5 | 438.3 | 409.5 | 77.4  | 498.8 | 190.3 | 318.9 | 110.3 | -2160.8 |

## 4.比較表

以上で、スプレッドの違いによる3パターンのバックテストのデータが揃いました。  
それぞれのパターンでの実質スプレッドと、主要なテスト結果を比較表にまとめてみます。

| EURJPY   | XM        | 補正無し      | TariTali  |
|----------|-----------|-----------|-----------|
| 実質スプレッド  | 2.3       | 1.2       | 0.8       |
| 純益       | 249万1412円 | 294万8312円 | 315万5040円 |
| PF       | 1.85      | 2.02      | 2.11      |
| 最大ドローダウン | 85万2133円  | 84万9228円  | 84万9319円  |
| 相対ドローダウン | 84.50%    | 84.08%    | 84.06%    |

### ※補足

XM 単体でのバックテストでは反映させていませんでしたが、XM の運用では、それだけでも XMP というポイントが貯まり、ボーナスや現金に換金できます。



XMポイントは、トレードするたびに貯まり、ボーナスや現金に換金することができます。

ここでは、XMP を現金に換金するものと仮定し、XM と TariTali の純益の差から、XMP を利用した場合の補正を行います。

この補正を行う事により、TariTali を使用することで得られるキャッシュバック額詳細が判明します。

計算方法は次の通りです。

純益の差に、（キャッシュバック+XMP）合計に対してXMPの割合をかけることで、XMPの現金換金額が算出されます。

計算式は次の通りです。

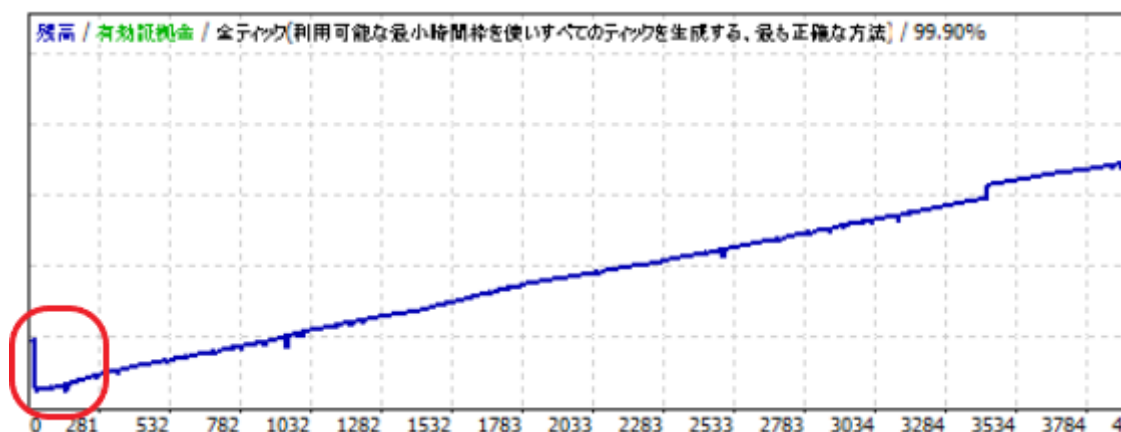
$$(315-249) \times 0.66 / (0.85 + 0.66) = \text{約 } 29 \text{ 万円}$$

XMPの現金換金額が29万円となりますので、TariTaliのキャッシュバック額詳細は次の通りです。

$$(315-249) - 29 = 37 \text{ 万円}$$

TariTali 経由で EA 運用するだけで、この37万円が直接あなたの銀行口座へ振り込まれるというわけです。

## 2 章：全ポジション損切り時の詳細検証



損益グラフを確認すると、テスト開始直後に大きく落ち込んでいるのがわかります。  
この部分が、全ポジション損切りが発動したタイミングになります。

デフォルト設定では全てのポジションが成立した時に、最後のポジションから 200pips  
下落したタイミングで発動されます。

|          |     |   |
|----------|-----|---|
| StopLoss | 200 | 保有ポジションが、他のパラメータ「MaxPosition」に達したときに適用されます。最終取得のポジションを期点として全てのポジションにStopLossがセットされます。(200 = 2円) |
|----------|-----|---|



# 1.全損時のポジション推移

せっかくバックテストで損切り発動したので、クオンツアナライザーでトレード詳細を見てみましょう。

こちらの画像は全ポジション損切り時の、8ポジションの推移です。

| Open time           | ① Open price | Size | Close time          | ② Close price | Time in trade | ③ Profit/Loss |
|---------------------|--------------|------|---------------------|---------------|---------------|---------------|
| 14.01.2010 15:45:00 | 132.54       | 0.1  | 25.02.2010 08:43:00 | 120.25        | 41d 16h 58m   | \$ -120157.62 |
| 15.01.2010 17:00:00 | 130.735      | 0.1  | 25.02.2010 08:43:00 | 120.25        | 40d 15h 43m   | \$ -102172.92 |
| 20.01.2010 10:10:00 | 128.875      | 0.1  | 25.02.2010 08:43:00 | 120.25        | 35d 22h 33m   | \$ -83768.8   |
| 21.01.2010 21:15:00 | 127.285      | 0.1  | 25.02.2010 08:43:00 | 120.25        | 34d 11h 28m   | \$ -68064.69  |
| 26.01.2010 11:30:00 | 125.965      | 0.1  | 25.02.2010 08:43:00 | 120.25        | 29d 21h 13m   | \$ -55060.57  |
| 04.02.2010 18:10:00 | 124.395      | 0.1  | 25.02.2010 08:43:00 | 120.25        | 20d 14h 33m   | \$ -40078.81  |
| 04.02.2010 18:30:00 | 123.305      | 0.1  | 25.02.2010 08:43:00 | 120.25        | 20d 14h 13m   | \$ -29178.81  |
| 05.02.2010 17:05:00 | 122.25       | 0.1  | 25.02.2010 08:43:00 | 120.25        | 19d 15h 38m   | \$ -18694.11  |

①が建値、②が決済値、③が損益データです。

132.54 円から 122.25 円まで 10.29 円に渡って買い下がり、120.25 円で全損です。

つまり、41 日かけた 12.29 円の下落で全ポジション損切りが発動したことになります。割とあっさりと言切りが発動したように思えますね。

では、12 円ちょっとの下落を受ければ毎回全損が発生するのか？  
と言え、そうではありません。

## 2.当時のチャート推移



これが当時の日足チャートです。

全損時の下落幅は 14 円弱で比較的緩やかな下降となっています。

その後5月4日から6日3日で約15円のより急激な下落が起こっているのがわかりますよね。

しかし、この下落では全損は発動していません。

この時のトレード詳細をクオンツアナライザーで見えます。

| Open time           | Open price | Size | Close time          | Close price | Time in trade | Profit/Loss  |
|---------------------|------------|------|---------------------|-------------|---------------|--------------|
| 04.05.2010 09:50:00 | 124.93     | 0.1  | 10.05.2010 09:05:00 | 120.43      | 5d 23h 15m    | \$ -44608.23 |
| 04.05.2010 20:20:00 | 122.94     | 0.1  | 10.05.2010 09:05:00 | 120.43      | 5d 12h 45m    | \$ -24708.23 |
| 05.05.2010 21:50:00 | 119.995    | 0.1  | 10.05.2010 09:05:00 | 120.43      | 4d 11h 15m    | \$ 4676.47   |
| 06.05.2010 21:20:00 | 113.805    | 0.1  | 10.05.2010 09:05:00 | 120.43      | 3d 11h 45m    | \$ 66380.59  |

124.93 円から 113.805 円まで 11.125 円に渡って買い下がっていますが、4 ポジションしか建てていません。

その後、120.43 円で 4 ポジション同時決済によりトータル利益を残しています。

この検証でわかることは、トラリピのように単純に下落に伴って等間隔にポジションを建てるわけではないということです。

つまり、急落時に多くのポジションを建ててしまわないようなロジックが組み込まれていると推測されます。

AI Rig 03 の開発に相当な時間と労力がかけられている事がわかりますね。

次に、全損時とその後の急落時の、より詳細なトレードの様子を検証するために、ビジュアルモードでのバックテストを行っていきます。

### 3. ビジュアルモードでのバックテスト比較

### 3-1.全損時バックテスト

・エントリー時



比較的緩やかな下落中に、ナンピンを行い平均取得単価を下げながら最大数の 8 ポジションを建てた状態です。

ポジションが増えるたびに、TP（利益確定ライン）が変更されてきたのですが、一度もTPに達せずこうなりました。

・エグジット時



その後、一旦上昇していきましたが、TPにまでは至らず、再下落。全ポジション損切りとなっています。

## 3-2.急落時バックテスト



3日間で15円以上という大幅な急落にもかかわらず、4ポジションまでしか増えず、保有4ポジションの平均取得単価の上に設定されたTPに達して、トータル利益を出して決済されています。

## 3-3.比較表

12円の下落で全損に至った場合と、15円の急落でも利益が出た場合の何が違うのか？各ポジション間の間隔の開きを、建てた時間差とレート差で表にしてみました。

### ・全損時ポジション差

| ポジション間 | 1～2    | 2～3      | 3～4    | 4～5      | 5～6      | 6～7   | 7～8     |
|--------|--------|----------|--------|----------|----------|-------|---------|
| レート差   | 1.8円   | 1.86円    | 1.59円  | 1.32円    | 1.57円    | 1.09円 | 1.06円   |
| 時間差    | 8時間15分 | 130時間15分 | 35時間5分 | 110時間15分 | 222時間40分 | 20分   | 22時間35分 |

### ・急落時ポジション差

| ポジション間 | 1～2     | 2～3     | 3～4     |
|--------|---------|---------|---------|
| レート差   | 2.03円   | 2.9円    | 6.19円   |
| 時間差    | 10時間30分 | 25時間30分 | 23時間30分 |

全損時は比較的狭いレート差でポジションを建てる時間差が大きく、急落時はレート差が広く時間差は少ない事がわかります。

急落時には単純に下落に伴ってポジションを増やしていくのではなく、時間や他の要素も考えられていることがわかります。

想定外の指標発表やフラッシュクラッシュなどの急落を考慮したロジックだと思われます。

さすが、売れているだけの事はある、よく考えられているEAだと感じます。

## 4.損切りをするか保有するかの考察

バックテストの結果、2010年1月の下落で全ポジション損切りが発動する事がわかりました。

損切り時の平均取得単価は126.919円、総ポジション数が8万通貨、損切りレートが120.25円ですから、損害額は※53万3500円となります。

※計算値

では、その後、EURJPYのレートがどうなったのか確認してみます。



全損時の損切りレートが赤ラインの120.25円、青ラインが利確ラインの127.003円辺りです。

つまり、損切りせずに耐えていれば利確していたという事です。

では、損切りはしない方がいいのか？というとまた別の話になります。

仮に損切りせずに保有していて、利確レートまで上昇しなかったとします。

チャートに表示されている範囲に限っても、その後105円付近まで下落しています。平均取得単価126.919円の総ポジション数8万通貨を105円まで保有していたら、含み損はいくらになるでしょうか？

$$(126.919 - 105) \times 80000 = 1753520$$

というわけで、105円時の含み損は175万3520円になります。

これ、耐えられますか？

この場合の下落幅は22円程度であり、EURJPYではそれほど珍しくない下落と言えます。

つまり、運悪く全ポジションを保有してさらに下落するなら、潔く損切りロジックに従った方がいいということです。

もちろんファンダメンタル分析の結果、自己責任でパラメータ変更を行い、保有しても構いません。

その場合のファンダ以外の保有条件を挙げておきます。

- ・条件1：資金に対しての含み損の割合が少ない事

例えば、上記した含み損175万3520円を抱えてしまっても、資金が1000万円以上もあればそれほどストレスを感じることなく保有できますよねって話です。

- ・条件2：プラススワップであること

プラススワップであれば、保有しているポジション量に対して日々スワップ額が増えていきます。

何もしなくても資金が増えていくわけですから、保有に対してのストレスはむしろ楽しみになるはずです。

## 3章：AI Rig 03 の運用方法

EAでの自動売買を行うにあたり、資金管理とEAの特性を把握しておくことが重要です。資金管理が出来ていないと、損失が出た場合、運用を続けられなく可能性があります。

AI Rig 03 は優れたEAですが、万能ではありません。  
デメリットを把握し、いざという場合の準備をしておくことで、落ち着いて対処できるハズです。

ほとんどの人がEAで儲けられないのは、ロットが大きすぎて1回のドローダウンで資金が尽きてしまうか、EAが信じられなくなって稼働を止めてしまうからです。

**FXをやめてしまうとFXで儲けることはもうできません。**

### 1.AI Rig 03 の資金管理

AI Rig 03 を運用する場合、自分の資金量でどのくらいのロットを運用すればいいのか迷われると思います。

そんな場合は、資金量に対しての損切り額の割合で考えるといいでしょう。

AI Rig 03 で1万通貨を運用した場合の全ポジション損切り額は※53万3500円です。

※計算値

仮に初期資金が50万円だった場合、EAによる損切りを待たずしてロスカットで証拠金を残して全損、もしくはゼロカットで所持金0となります。

では初期資金が500万円だった場合の損切り額の割合はどうでしょう？

500万に対しての53万ですから、ほぼ1/10ということでそれほど痛くは感じないでしょう。

が、資金効率という面でいえば、効率はいいとは言えません。

販売ページでの推奨ロットは100万円あたり1万通貨とされていますが、私のお勧めする初期資金と運用ロットは、100万円あたり5000通貨です。

5000通貨であれば、全損時の損害額は26万7000円ほど。

つまり、資金の変動とともに、全損額の割合を1/4程度になるようロット調整をしていれば、資金効率のいい運用ができるのかと思います。

## 2.AI Rig 03 のデメリットと対策

AI Rig 03 はスキャルピング要素とナンピン要素を組み合わせた、非常に優れた EA です。しかし、どれだけ高性能な EA であっても、どんな相場でも儲かり続けるわけではありません。

ここからはデメリットと注意すべき点について主に解説していきます。

**AI Rig 03 のデメリットはナンピン時にあります。**

スキャルピングで日々利益を上げているうちは問題ないのですが、レートがどんどん逆行して含み損とナンピンポジションが増えてきた場合、何か月もトレード益が出ない場合があります。

もう一度年月度別損益表を貼ってみます。

MONTHLY PERFORMANCE (\$)

| Year | Jan      | Feb        | Mar      | Apr       | May      | Jun      | Jul      | Aug      | Sep      | Oct      | Nov      | Dec      | YTD        |
|------|----------|------------|----------|-----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|------------|
| 2023 | 15163.53 | 21519.99   | 27877.62 | 56.47     | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 64617.61   |
| 2022 | 10125.87 | 16307.65   | 44239.4  | 33151.74  | 53214.7  | 50377.64 | 31932.36 | 47365.27 | 35677.05 | 26632.93 | 22003.54 | 25220.6  | 396248.75  |
| 2021 | 12438.83 | 14258.23   | 11258.83 | 17762.93  | 16913.5  | 14600.57 | 6888.85  | 4950.01  | 15738.82 | 27627.63 | 1150.58  | 9435.37  | 153024.15  |
| 2020 | 6502.35  | 5455.33    | 75605.87 | 11691.19  | 15606.47 | 11225.88 | 20426.5  | 26997.03 | 11084.72 | 17944.69 | 18437.05 | 15268.82 | 236245.9   |
| 2019 | 0        | 19609.43   | 9936.48  | 11522.94  | 0        | 0        | 0        | 0        | 0        | 68593.43 | 10814.11 | 12228.83 | 132705.22  |
| 2018 | 23303.54 | 5001.17    | 0        | 24734.82  | 0        | 36353    | 16169.41 | 13687.09 | 20403.32 | 15828.23 | 22854.11 | 21242.93 | 203977.82  |
| 2017 | 24667.64 | 0          | 15837.68 | 142046.52 | 34061.18 | 26448.83 | 22552.93 | 19600.59 | 23204.11 | 16197.63 | 12943.54 | 14043.53 | 351604.18  |
| 2016 | 7258.86  | 18641.17   | 22716.49 | 22756.49  | 27497.64 | 6033.57  | 24362.94 | 9081.78  | 10560.02 | 19476.45 | 39238.81 | 27587.63 | 235211.85  |
| 2015 | 34998.81 | 22655.28   | 17778.84 | 35731.76  | 33336.45 | 19388.81 | 46352.33 | 22767.64 | 22448.84 | 13552.94 | 0        | 35628.88 | 304640.58  |
| 2014 | 22383.52 | 27859.43   | 11517.08 | 20224.69  | 13472.36 | 5640     | 0        | 12856.53 | 12469.41 | 14378.86 | 31057.04 | 19910.57 | 191769.49  |
| 2013 | 43682.93 | 41262.33   | 36317.63 | 42200     | 28113.53 | 30088.82 | 28658.23 | 24529.43 | 30019.99 | 24158.22 | 24877.07 | 12038.82 | 365947     |
| 2012 | 13902.41 | 29405.31   | 25831.78 | 14299.43  | 12195.29 | 28952.37 | 2425.29  | 24710.06 | 15778.22 | 17802.36 | 23832.94 | 14807.65 | 223943.11  |
| 2011 | 22003.56 | 25334.09   | 39084.68 | 41438.81  | 18404.71 | 20384.72 | 21030.62 | 39345.86 | 0        | 31817.15 | 275.29   | 12831.8  | 271951.29  |
| 2010 | 10033.53 | -510926.33 | 33605.89 | 21124.11  | 47258.82 | 45561.17 | 42900.58 | 11442.36 | 50359.99 | 18717.04 | 31894.69 | 14451.79 | -183576.36 |

2019年の5月から9月まで利益0の月が続いています。

この間、保有しているポジションに付与されるスワップがプラスであれば、まだいいんですよ。

5ヵ月も保有していれば決済した時に、結構な額になるでしょうしむしろホクホクです。

が、毎日スワップを払う**マイナススワップ**だったらどうですか？

大事な事なので繰り返しますが、何もしなくてもお金が減っていくストレスは異常です。ポジションを決済しようにも、含み損がある状態では切るに切れず、ずるずるとマイナススワップを払い続けることになります。

しかも、いつ終わるともわからないうちに、全ポジション損切りになるかもしれない状況



です。

最悪じゃありませんか？

ナンピンをしてポジションが増えてしまうと、簡単には決済できません。

だからこそ、絶対にマイナススワップでの運用をしてはいけません。

EURJPY の買いスワップがマイナスになったら、即座に EA の運用を中止すべきです。

仮にポジションを抱えた状態でスワップがマイナスに反転した場合、含み損額によっては即刻損切りも検討しなければいけないでしょう。

つい数年前まで EURJPY のスワップは売りがプラスでした。

その当時から売りポジションを保有しているトラリピ勢はみんな悲鳴を上げています。

しつこいようですが繰り返します。

EURJPY の買いがマイナススワップになったら AI Rig 03 の運用を停止してください。

というワケで AI Rig 03 のデメリットと運用時の対策をまとめると次のようになります。

## 2-1.AI Rig 03 のデメリット

- ・ナンピンが裏目に出た場合の全ポジション損切り額が大きい
- ・EURJPY の買いスワップがマイナスになった場合、保有ポジションに対して支払う必要がある

## 2-2.対策

- ・全ポジション損切りの割合を運用資金の 1/4 程度になるようロット管理する
- ・EURJPY の買いスワップがマイナスになった場合は運用を停止する

以上を徹底して運用を続ける限り、AI Rig 03 はあなたに利益をもたらし続けてくれるはずです。

## ・最後に

EA 運用は正確なバックテストとフォワードテストにより、テスト通りの結果が出る事を確認していれば、安心して運用できます。

EA の特徴を知り、いざという時に起こりうる損失を把握しておくことで、『こんなハズじゃなかった』といった事態を防ぐことができます。

**EA に限ったことではなく、FX をやめてしまうと FX で稼ぐことはできません。  
※非常に大事な事なので繰り返しています。**

EA で稼ぐコツは『信じて継続する』ことです。

EA 運用をやめてしまう原因のほとんどが、大きな損失を出して EA を信じられなくなることです。

一時的なドロウダウンが起こっても、そのまま運用を続けていればトータルで儲かる事が理解できていないことが原因で、一番損したところでやめてしまうワケです。

だからこそ、やるべきことを尽くして『EA に任せていたら最終的に儲かる』といった心境に達したら、なるべく放置運用を行う事が望ましいです。

まさに『人事を尽くして天命を待つ』とか『果報は寝て待て』の心境ですね。

AI Rig 03 の購入特典は以上となります。

あなたが AI Rig 03 をポートフォリオの一部とし、末永く EA 運用で資産を増やし続けられるよう願っています。