

mu-fa バージョン290

リスクレベル3

変更点および注意点

前バージョンからの変更点

<前バージョン>

相場によって損切りを**頻繁に**実施

メリット：

大きな含み損を抱えない

デメリット：

①レンジ相場などで損切の回数が増えるほど、これまでの利益がどんどん削られる

②月全体で損失となる場合も出る（**複数月連続**して損失になるパターンあり）

③どこで損失が増えるのか分からない→損失予定が不明でコントロールもできない = **不安**

<新バージョン>

できるだけ損切をしないように調整（投資の神様「ウォーレン・バフェット」の手法）

メリット：

①高勝率でマイナス月がほぼなくなる（残高ベース）

②損切をしないので全体を通して大きな利益になる

デメリット：

①時には大きな**含み損**をかかえる

ただし含み損は相場に比例するので、簡単にコントロールできる = **安心**（後述）

利益性能

@リスクレベル3

5年間の複利で+4252%
(原資比43倍)
100万円→4352万円



単利（利確毎）で回収の場合は+1800%

https://mu-fa.xxvxx.net/data/report/backtest/v290_Lv3.htm

Strategy Tester Report

v290

Exness-Real9 (Build 1441)

通貨ペア	BTCUSD (Bitcoin vs US Dollar)				
期間	5分足(M5) 2020.01.01 08:20 - 2025.03.10 23:55 (2020.01.01 - 2025.03.11)		←性能比較のため 旧バージョンと同じ期間で確認		
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	TestLev=10; SERIALID="*****" BOOTPASS=""; MAILAD=""; NOTICE=""; MyLev=3; ProfitLimit=-1;				
テストバー数	505940	モデルティック数	604589899	モデリング品質	n/a
不整合チャートエラー	0				
初期証拠金	10000.00	スプレッド		現在価 (1340)	
純益	425272.13	総利益	522000.02	総損失	-96727.89
プロフィットファクタ	5.4	期待利得	94.4		
絶対ドローダウン	40440.61	最大ドローダウン	164045.07(71.11%)	相対ドローダウン	71.11%(164045.07)
総取引数	4505	売りポジション(勝率%)	1672(67.4)%	買いポジション(勝率%)	2833(99.72)%
		勝率(%)	3952(87.72%)	負率(%)	553(12.28)%
	最大 勝トレード	↑トレード勝率87%	27712.17	敗トレード	-37910.23
	平均 勝トレード		132.09	敗トレード	-174.91
	最大 連勝(金額)		49(44441.27)	連敗(金額)	1(-37910.23)
	最大 連勝(トレード数)		44441.27(49)	連敗(トレード数)	-37910.23(1)
	平均 連勝		8	連敗	

←性能比較のため
旧バージョンと同じ期間で確認



注意点：

下落相場と含み損と
そのコントロールについて

含み損について

<まずは相場の年々の変化の話>

新バージョンでは2022年に**-71%**の含み損を抱える結果となった。

この時のビットコインは最高値から**-80%**の下落を記録しているが、
まずはこの先その相場の再来があるか、について考察。

※含み損が-100%になると
取引所から強制決済（全ロスカット）となります



-80%相場の再来はあるのか？

結論から申し上げますと**-80%相場の再来はまずない**と考えています。

<根拠>

ビットコインの市場規模は年々増加しており、金融相場的一般法則として、**市場規模が大きいほど価格は安定する**（大きな変動は起きにくくなる）というものがあります。

2022年にはビットコインの市場規模は**300億**ドル、2025年時点では**1.9兆ドル**と、実に**60倍**の規模になっています。

これは2024年にビットコインがETFに上場した事が大きな要因で、ETF上場後から現時点までのBTC最大下落幅は**-32%**となっています。

※だからと言って絶対に起きないという保証ではありません

それでももし起きたら？の対策

<含み損%のコントロール>

今回のバージョンのロジックは**相場下落と含み損の関係は比例**するので、大きな含み損や急落が**不安**になったら証拠金を足す方法が最もシンプル



相場-80%の時→含み損-71%

相場-100%の時→含み損-88%

含み損が-100%を超えると強制決済が発生します。

上記は計算上では最大でも含み損-88%ですが、必ず-88%以内となる保証ではないため、このやり方をお伝えしています。

相場-80%の時に
証拠金を**2倍**にした場合
(例：20万円→40万円)

相場-80%→含み損**-36%**

相場-100%→含み損**-44%**

つまり含み損%は**2分の1**となります。

※同じ証拠金を足すのが厳しい場合、
そもそも**半額を投資**、半額を補填用に置く。

このやり方をすれば
理論上、破綻はありません。