

EAバックテスト監査報告書

【ライト監査】

サンプル版
お客様のEA監査のご検討用に、実際のテスターレポートを用いて作成した見本です

対象EA	LonerWave3_EA_v1.0
通貨ペア / 時間足	USDJPY / 5分足(M5)
テスト期間	2017.01.02 - 2026.08.20
監査データ	ストラテジーテスター報告書 (XMTradingMU-Real 262 (Build 1476))
総合判定	【 要フォワード 】
報告書作成	rehav

お客様のEAのテスト成績・販売ページ・口座履歴をチェックし、「この数字を信じていいかどうか」を判定します。

本サンプルはご依頼者ご自身のEAのテスターレポートに基づいて作成しています。EAのファイル・設定・成績は実監査の場合、納品から30日後に完全消去します。

1. 監査対象の概要

通貨ペア	USDJPY (US Dollar vs Japanese Yen)
期間	2017.01.02 - 2026.08.20 (テストバー数 718,737 / モデルティック数 182,661,439)
モデル	全ティック / モデリング品質 90.00% / 不整合チャートエラー 0
初期証拠金	10,000.00 スプレッド : 10ポイント (固定) = 1.0pip
純益	791.32 (総利益 934.47 / 総損失 -143.15)
プロフィットファクター	6.53 / 期待利得 22.61
ドローダウン	絶対 61.48 / 最大 203.52 (2.01%)
取引数	35 (買い25 / 売り10) / 34勝1敗 (勝率97.14%)
連勝・連敗	最大28連勝 (+812.73) / 最大連敗 1 (-143.15)

9.6年間で35トレード、勝率97.14%、PF 6.53という高勝率型の成績です。一見極めて優秀ですが、勝率が高いほど「数字の見せ方」による粉飾が通用しやすいため、本監査では設定条件と構造の健全性を重点的に確認します。

2. 監査結果サマリ

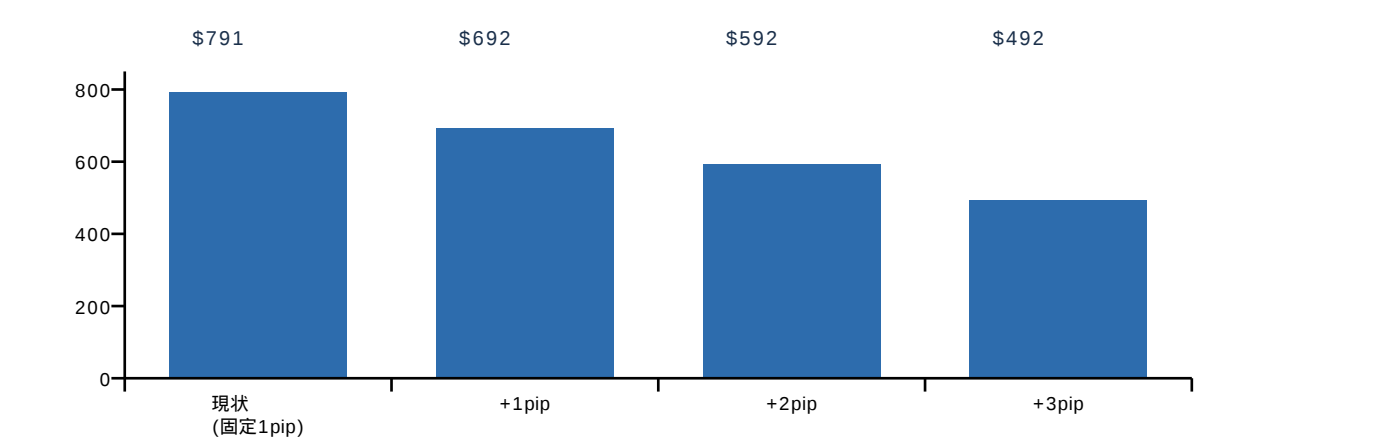
監査項目	結果	判定
手数料 (スプレッド) の見積もり	固定1.0pip。実勢よりやや甘い要素あり (深夜帯エントリー22.9%)	注意
損切り構造の健全性	SL常設・ナンピンなし・リスク1.0 ~ 1.85% / トレードで破綻リスクは低い。ただしSL / TP比5.7倍の非対称構造	○ 問題なし
販売条件との整合性	期間・モデル・レポート内部の整合に問題なし。ただし最終取引から約1年10ヶ月の無取引期間あり	○ 問題なし

総合判定： 要フォワード

テスト自体に粉飾やデータ破損の痕跡はなく、損切り構造も健全です。一方で、スプレッド設定が実勢よりやや有利に働く可能性があり、また高勝率型に特有の「1回の負けで成績構造が崩れる」非対称性を抱えています。実運用の前に、まずデモ口座でのフォワード確認 (3 ~ 6ヶ月) を推奨します。

3-1. チェック : スプレッド設定は現実的か

テストの
スプレッドは「10ポイント (固定) = 1.0pip」です。XMのUSDJPY平均スプレッドはおおむね1.0 ~ 1.6pipですが、本EAのエントリー35件のうち8件 (22.9%) がサーバー時間02:00 ~ 06:00の流動性が薄い時間帯に集中しています。この時間帯の実スプレッドは2 ~ 3pipに拡大することが多く、固定1.0pipはやや甘い見積もりです。



▲ スプレッドが実際より広がった場合の純益への影響（テスター値 \$791.32 基準）

+1pip（計2.0pip）	コスト\$99.74 → 純益\$691.58（-12.6%）
+2pip（計3.0pip）	コスト\$199.49 → 純益\$591.83（-25.2%）
+3pip（計4.0pip）	コスト\$299.23 → 純益\$492.09（-37.8%）

結論：スプレッド想定が1pip崩れるだけで利益が約13%減、3pip広がれば約4割減です。平均TPが11.4pipsと短く、コスト感応度が高い構造です。この点が判定「危険」の主因です。

3-2. チェック：損切りの仕組みは破綻しないか

損切り注文	全35トレードでSL常設（100%）。損切りなしの「塩漬け」なし
ロット構造	0.10～0.60ロット（平均0.33）。残高連動の複利型で、負け後のロット増（ナンピン）なし
1トレード最大リスク	\$184.51（初期証拠金比1.85%）。RiskPercent=1%設定通り
SL / TP の距離	平均SL 64.8pips vs 平均TP 11.4pips（リスク:リターン 5.7 : 1）
唯一の負けトレード	-\$143.15（-50.7pips、2018.03）。残高比 -1.43%で問題の規模ではない

結論：破綻を招く構造（マーチンゲール・損切り拡大・塩漬け）は確認されませんでした。○
ただし「勝ち\$27.48を積み上げ、負けると平均\$143.15」という非対称構造のため、損益分岐勝率は83.9%です。現在の97.14%との間に余裕はありますが、この型の成績は「負けが連続し始めた瞬間」に急速に崩れる性質があるため、運用中の勝率監視が必須です。

3-3. チェック：テスト条件の整合性

期間の整合	テスト期間 2017.01～2026.08 と最終取引日 2024.10.14 の間に約1年10ヶ月の無取引期間。ゲート条件が厳しい可能性
モデル品質	90.00%（全ティック）。高品質だが、2分～57時間の幅がある保有時間のうち短い側はティック補間の影響を受ける
チャートエラー	不整合チャートエラー 0件。価格データ破損の痕跡なし（冒頭の監査例のような「終値が始値」問題は確認されず）
レポート内部整合	各取引の損益・残高・pips計算を全件再計算し、レポート記載値と一致することを確認済み

結論：数字の捏造やデータ破損を疑う痕跡はありません。ただし「直近1年10ヶ月で一度もエントリーしていない」点は、販売ページ等で謳う場合は必ず明記すべき事実です（実運用でも同様に長期間ノーシグナルになり得ます）。

4. 総合判定

要フォワード（テスト上は良好。実運用前にデモ口座での確認を推奨）

監査3項目のうち2項目は問題なし、スプレッド設定に注意が必要です。数字そのものは信頼できる範囲にありますが、実環境（広がるスプレッド・約定スリッページ）では純益が10～40%目減りする前提で判断してください。

推奨アクション

1. 3～6ヶ月のデモ口座フォワードで実スプレッド・約定を確認する
2. エントリー時間帯（02:00～06:00）の実スプレッドを事前計測するか、時間帯フィルタを検討する
3. 運用中は勝率の低下（85%割れ）をアラート条件に設定する

フル監査（+オプション）では、売買ルールを全て取り出し、実ブローカーデータによる10年分の再検証と統計的有意性の検定を行います。本レポートの次ページ相当の内容が含まれます。