

MM		
Data Início e Fim:	2020-10-07	2021-05-04
#trades positivos:	465	56,8%
#trades negativos:	354	43,2%
#Trades	819	100,0%
Tempo (dias):	210	3,90 Op/dia
#Pregões e #Op/Pregão:	135	6,07 Op/Pregão
Média \$ por Trade(1):	5.000,00	5.000,00
Lucro dos trades ganhadores:	14.479,00	
Prejuízo dos trades perdedores:	-12.752,00	
Lucro:	1.727,00	
Lucro por Dia:	8,22	
Lucro por Pregão:	12,79	
Lucro dos trade ganhadores / trade:	31,14	0,62%
Prejuízo dos trades perdedores / trade:	-36,02	-0,72%
Maior perda absoluta / trade:	-328,00	
Maior perda relativa / trade:	-6,56%	
% Atual:	34,54%	34,54%
% por Dia:	0,14%	0,14%
% por Pregão:	0,22%	0,22%
% por trade:	0,042%	
Rentabilidade Mensal:	4,39%	
Payoff:	0,86	
G/R Efetivo:	1,14	
Drawdown Máximo:	12,10%	
Expectativa Matemática:	R\$ 2,11	
Índice Sharpe:	0,06	
Fator de Lucro:	1,14	
SQN:	1,48	
ERA:	R\$ 0,06	

G/R efetivo (razão ganho risco, às vezes R/G) é o payoff se o percentual de acerto fosse de 50%. Equivale ao Fator de Lucro.

g = média de ganho; p = média de perda; a = percentual de certo; e = percentual de erro.

$G/R = g \times a / (p \times e) = (g / p) \times (a / e) = \text{payoff} \times (a / e)$.

Índice Sharpe é igual à ERA que é igual à EM pela perda média (p)

SQN deve ser maior que 1 para ter qualidade mínima para ser usado. Quanto maior, melhor.

ERA = Expectativa por cada Real Arriscado.

ERA = Expectativa Matemática / Perda Média por Trade ou EM/ p

https://github.com/sandrorb/SrB_MM_robot/blob/main/SrB_EA_MM_Robot.mq5

<https://www.viverdeforex.com/o-guia-definitivo-de-van-tharp-para-medir-a-qualidade-de-um-sistema>