

## MM

<b>Data Início e Fim:</b>	2020-10-07	2021-07-29
<b>#trades positivos:</b>	609	55,1%
<b>#trades negativos:</b>	496	44,9%
<b>#Trades</b>	1105	100,0%
<b>Tempo (dias):</b>	296	3,73 Op/dia
<b>#Pregões e #Op/Pregão:</b>	194	5,70 Op/Pregão
<b>Média \$ por Trade(1):</b>	5.000,00	5.000,00
<b>Lucro dos trades ganhadores:</b>	17.215,00	
<b>Prejuízo dos trades perdedores:</b>	-14.749,00	
<b>Lucro:</b>	2.466,00	
<b>Lucro por Dia:</b>	8,33	
<b>Lucro por Pregão:</b>	12,71	
<b>Lucro dos trade ganhadores / trade:</b>	28,27	0,57%
<b>Prejuízo dos trades perdedores / trade:</b>	-29,74	-0,59%
<b>Maior perda absoluta / trade:</b>	-164,00	
<b>Maior perda relativa / trade:</b>	-3,28%	
<b>% Atual:</b>	49,32%	49,32%
<b>% por Dia (js):</b>	0,17%	0,14%
<b>% por Pregão (js):</b>	0,25%	0,21%
<b>% por trade:</b>	0,045%	
<b>Rentabilidade Mensal (js):</b>	5,07%	
<b>Payoff:</b>	0,95	
<b>Edge:</b>	3,85%	
<b>G/R Efetivo:</b>	1,17	
<b>Drawdown Máximo:</b>	12,10%	
<b>Expectativa Matemática:</b>	R\$ 2,23	

<b>Índice Sharpe:</b>	0,08
<b>Fator de Lucro:</b>	1,17
<b>SQN:</b>	0,64
<b>ERA:</b>	R\$ 0,08

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)

Edge = %acerto - Break-even; Break-even =  $1 / (1 + RR = \text{payoff})$

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://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>