

MM		
Data Início e Fim:	2020-10-07	2021-04-15
#trades positivos:	432	57,9%
#trades negativos:	314	42,1%
#Trades	746	100,0%
Tempo (dias):	191	3,91 Op/dia
#Pregões e #Op/Pregão:	123	6,07 Op/Pregão
Média \$ por Trade(1):	5.000,00	5.000,00
Lucro dos trades ganhadores:	12.959,00	
Prejuízo dos trades perdedores:	-10.503,00	
Lucro:	2.456,00	
Lucro por Dia:	12,86	
Lucro por Pregão:	19,97	
Lucro dos trade ganhadores / trade:	30,00	0,60%
Prejuízo dos trades perdedores / trade:	-33,45	-0,67%
Maior perda absoluta / trade:	-164,00	
Maior perda relativa / trade:	-3,28%	
% Atual:	49,12%	49,12%
% por Dia:	0,21%	0,21%
% por Pregão:	0,33%	0,33%
% por trade:	0,066%	
Rentabilidade Mensal:	6,57%	
Payoff:	0,90	
G/R Efetivo:	1,23	
Drawdown Máximo:	15,28%	
Expectativa Matemática:	R\$ 3,29	
Índice Sharpe:	0,10	
Fator de Lucro:	1,23	
SQN:	2,18	
ERA:	R\$ 0,10	

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>