

MM

Data Início e Fim:	2020-10-07	2021-08-11
#trades positivos:	628	55,4%
#trades negativos:	505	44,6%
#Trades	1133	100,0%
Tempo (dias):	309	3,67 Op/dia
#Pregões e #Op/Pregão:	202	5,61 Op/Pregão
Média \$ por Trade(1):	5.000,00	5.000,00
Lucro dos trades ganhadores:	18.071,00	
Prejuízo dos trades perdedores:	-15.303,00	
Lucro:	2.768,00	
Lucro por Dia:	8,96	
Lucro por Pregão:	13,70	
Lucro dos trade ganhadores / trade:	28,78	0,58%
Prejuízo dos trades perdedores / trade:	-30,30	-0,61%
Maior perda absoluta / trade:	-164,00	
Maior perda relativa / trade:	-3,28%	
% Atual:	55,36%	55,36%
% por Dia (js):	0,18%	0,14%
% por Pregão (js):	0,27%	0,22%
% por trade:	0,049%	
Rentabilidade Mensal (js):	5,45%	
Payoff:	0,95	
Edge:	4,14%	
G/R Efetivo:	1,18	
Drawdown Máximo:	12,10%	
Expectativa Matemática:	R\$ 2,44	

Índice Sharpe:	0,08
Fator de Lucro:	1,18
SQN:	0,68
ERA:	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://www.viverdeforex.com/o-guia-definitivo-de-van-tharp-para-medir-a-qualidade-de-um-sistema>