

As estatísticas aqui são por contrato

MM

Data Início e Fim:	2020-10-07	2021-06-30
#trades positivos:	574	55,7%
#trades negativos:	457	44,3%
#Trades	1031	100,0%
Tempo (dias):	267	3,86 Op/dia
#Pregões e #Op/Pregão:	175	5,89 Op/Pregão
Média \$ por Trade(1):	5.000,00	5.000,00
Lucro dos trades ganhadores:	16.059,00	
Prejuízo dos trades perdedores:	-13.595,00	
Lucro:	2.464,00	
Lucro por Dia:	9,23	
Lucro por Pregão:	14,08	
Lucro dos trade ganhadores / trade:	27,98	0,56%
Prejuízo dos trades perdedores / trade:	-29,75	-0,59%
Maior perda absoluta / trade:	-164,00	
Maior perda relativa / trade:	-3,28%	
% Atual:	49,28%	49,28%
% por Dia:	0,15%	0,15%
% por Pregão:	0,23%	0,23%
% por trade:	0,048%	
Rentabilidade Mensal:	4,67%	
Payoff:	0,94	
G/R Efetivo:	1,18	
Drawdown Máximo:	12,10%	
Expectativa Matemática:	R\$ 2,39	

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)

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>