

MM		
Data Início e Fim:	2020-10-07	2021-06-21
#trades positivos:	555	56,2%
#trades negativos:	433	43,8%
#Trades	988	100,0%
Tempo (dias):	258	3,83 Op/dia
#Pregões e #Op/Pregão:	168	5,88 Op/Pregão
Média \$ por Trade(1):	5.000,00	5.000,00
Lucro dos trades ganhadores:	18.817,00	
Prejuízo dos trades perdedores:	-15.800,00	
Lucro:	3.017,00	
Lucro por Dia:	11,69	
Lucro por Pregão:	17,96	
Lucro dos trade ganhadores / trade:	33,90	0,68%
Prejuízo dos trades perdedores / trade:	-36,49	-0,73%
Maior perda absoluta / trade:	-328,00	
Maior perda relativa / trade:	-6,56%	
% Atual:	60,34%	60,34%
% por Dia:	0,18%	0,18%
% por Pregão:	0,28%	0,28%
% por trade:	0,061%	
Rentabilidade Mensal:	5,73%	
Payoff:	0,93	
G/R Efetivo:	1,19	
Drawdown Máximo:	12,10%	
Expectativa Matemática:	R\$ 3,05	

Índice Sharpe:	0,08
Fator de Lucro:	1,19
SQN:	2,21
ERA:	R\$ 0,08

É necessário refazer os cálculos para normalizar o ganho por contrato.

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>