

MM

Data Início e Fim:	2020-10-07	2021-07-30
#trades positivos:	611	55,2%
#trades negativos:	496	44,8%
#Trades	1107	100,0%
Tempo (dias):	297	3,73 Op/dia
#Pregões e #Op/Pregão:	195	5,68 Op/Pregão
Média \$ por Trade(1):	5.000,00	5.000,00
Lucro dos trades ganhadores:	17.320,00	
Prejuízo dos trades perdedores:	-14.749,00	
Lucro:	2.571,00	
Lucro por Dia:	8,66	
Lucro por Pregão:	13,18	
Lucro dos trade ganhadores / trade:	28,35	0,57%
Prejuízo dos trades perdedores / trade:	-29,74	-0,59%
Maior perda absoluta / trade:	-164,00	
Maior perda relativa / trade:	-3,28%	
% Atual:	51,42%	51,42%
% por Dia (js):	0,17%	0,14%
% por Pregão (js):	0,26%	0,21%
% por trade:	0,047%	
Rentabilidade Mensal (js):	5,27%	
Payoff:	0,95	
Edge:	4,00%	
G/R Efetivo:	1,17	
Drawdown Máximo:	12,10%	
Expectativa Matemática:	R\$ 2,32	

Índice Sharpe:	0,08
Fator de Lucro:	1,17
SQN:	0,67
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>