

MM		
Data Início e Fim:	2020-10-07	2021-03-25
#trades positivos:	389	57,5%
#trades negativos:	287	42,5%
#Trades	676	100,0%
Tempo (dias):	170	3,98 Op/dia
#Pregões e #Op/Pregão:	109	6,20 Op/Pregão
Média \$ por Trade(1):	5.000,00	5.000,00
Lucro dos trades ganhadores:	11.626,00	
Prejuízo dos trades perdedores:	-9.660,00	
Lucro:	1.966,00	
Lucro por Dia:	11,56	
Lucro por Pregão:	18,04	
Lucro dos trade ganhadores / trade:	29,89	0,60%
Prejuízo dos trades perdedores / trade:	-33,66	-0,67%
Maior perda absoluta / trade:	-164,00	
Maior perda relativa / trade:	-3,28%	
% Atual:	39,32%	39,32%
% por Dia:	0,20%	0,20%
% por Pregão:	0,30%	0,30%
% por trade:	0,058%	
Rentabilidade Mensal:	6,12%	
Payoff:	0,89	
G/R Efetivo:	1,20	
Expectativa Matemática:	R\$ 2,91	

Índice Sharpe:	0,09
Fator de Lucro:	1,20
SQN:	1,87
ERA:	R\$ 0,09

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>