

As estatísticas aqui são por contrato

## MM

<b>Data Início e Fim:</b>	2020-10-07	2021-08-24
<b>#trades positivos:</b>	643	55,1%
<b>#trades negativos:</b>	525	44,9%
<b>#Trades</b>	1168	100,0%
<b>Tempo (dias):</b>	322	3,63 Op/dia
<b>#Pregões e #Op/Pregão:</b>	210	5,56 Op/Pregão
<b>Média \$ por Trade:</b>	5.000,00	5.000,00
<b>Lucro dos trades ganhadores:</b>	18.607,00	
<b>Prejuízo dos trades perdedores:</b>	-15.938,67	
<b>Lucro:</b>	2.668,33	
<b>Lucro por Dia:</b>	8,29	
<b>Lucro por Pregão:</b>	12,71	
<b>Lucro dos trade ganhadores / trade:</b>	28,94	0,58%
<b>Prejuízo dos trades perdedores / trade:</b>	-30,36	-0,61%
<b>Maior perda absoluta / trade:</b>	-164,00	
<b>Maior perda relativa / trade:</b>	-3,28%	
<b>% Atual:</b>	53,37%	53,37%
<b>% por Dia (js):</b>	0,17%	0,13%
<b>% por Pregão (js):</b>	0,25%	0,20%
<b>% por trade:</b>	0,046%	
<b>Rentabilidade Mensal (js):</b>	5,04%	
<b>Payoff:</b>	0,95	
<b>Edge:</b>	3,85%	
<b>G/R Efetivo:</b>	1,17	
<b>Drawdown Máximo:</b>	12,10%	
<b>Expectativa Matemática:</b>	R\$ 2,28	
<b>Índice Sharpe:</b>	0,08	
<b>Fator de Lucro:</b>	1,17	
<b>SQN:</b>	0,64	
<b>ERA:</b>	R\$ 0,08	

G/R efetivo (razão ganho risco efetivo) 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 =  $1 / (1 + \text{RR} = \text{payoff})$

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://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>