

As estatísticas aqui são por contrato

MM

Data Início e Fim:	2020-10-07	2021-07-07
#trades positivos:	585	55,5%
#trades negativos:	469	44,5%
#Trades	1054	100,0%
Tempo (dias):	274	3,85 Op/dia
#Pregões e #Op/Pregão:	180	5,86 Op/Pregão
Média \$ por Trade(1):	4.917,80	5.000,00
Lucro dos trades ganhadores:	16.441,00	
Prejuízo dos trades perdedores:	-13.976,00	
Lucro:	2.465,00	
Lucro por Dia:	9,00	
Lucro por Pregão:	13,69	
Lucro dos trade ganhadores / trade:	28,10	0,56%
Prejuízo dos trades perdedores / trade:	-29,80	-0,60%
Maior perda absoluta / trade:	-164,00	
Maior perda relativa / trade:	-4,11%	
% Atual:	50,12%	49,30%
% por Dia:	0,15%	0,15%
% por Pregão:	0,23%	0,22%
% por trade:	0,047%	
Rentabilidade Mensal:	4,62%	
Payoff:	0,94	
G/R Efetivo:	1,18	
Drawdown Máximo:	12,10%	
Expectativa Matemática:	R\$ 2,34	

Índice Sharpe:	0,08
Fator de Lucro:	1,18
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)

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>