

MM

Data Início e Fim:	2020-10-07	2021-09-06
#trades positivos:	657	54,7%
#trades negativos:	544	45,3%
#Trades	1201	100,0%
Tempo (dias):	335	3,59 Op/dia
#Pregões e #Op/Pregão:	219	5,48 Op/Pregão
Média \$ por Trade:	5.000,00	5.000,00
Lucro dos trades ganhadores:	19.008,33	
Prejuízo dos trades perdedores:	-16.624,67	
Lucro:	2.383,67	
Lucro por Dia:	7,12	
Lucro por Pregão:	10,88	
Lucro dos trade ganhadores / trade:	28,93	0,58%
Prejuízo dos trades perdedores / trade:	-30,56	-0,61%
Maior perda absoluta / trade:	-164,00	
Maior perda relativa / trade:	-3,28%	
% Atual:	47,67%	47,67%
% por Dia (js):	0,14%	0,12%
% por Pregão (js):	0,22%	0,18%
% por trade:	0,040%	
Rentabilidade Mensal (js):	4,33%	
Payoff:	0,95	
Edge:	3,34%	
G/R Efetivo:	1,14	
Drawdown Máximo:	12,10%	
Expectativa Matemática:	R\$ 1,98	
Índice Sharpe:	0,06	
Fator de Lucro:	1,14	
SQN:	0,57	
ERA:	R\$ 0,06	

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 = $1 / (1 + RR = \text{payoff})$

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>