

MM

| | | |
|------------------------------------------------|------------|----------------|
| Data Início e Fim: | 2020-10-07 | 2021-08-13 |
| #trades positivos: | 633 | 55,4% |
| #trades negativos: | 510 | 44,6% |
| #Trades | 1143 | 100,0% |
| Tempo (dias): | 311 | 3,68 Op/dia |
| #Pregões e #Op/Pregão: | 204 | 5,60 Op/Pregão |
| Média \$ por Trade: | 5.000,00 | 5.000,00 |
| Lucro dos trades ganhadores: | 18.257,00 | |
| Prejuízo dos trades perdedores: | -15.459,67 | |
| Lucro: | 2.797,33 | |
| Lucro por Dia: | 8,99 | |
| Lucro por Pregão: | 13,71 | |
| Lucro dos trade ganhadores / trade: | 28,84 | 0,58% |
| Prejuízo dos trades perdedores / trade: | -30,31 | -0,61% |
| Maior perda absoluta / trade: | -164,00 | |
| Maior perda relativa / trade: | -3,28% | |
| % Atual: | 55,95% | 55,95% |
| % por Dia (js): | 0,18% | 0,14% |
| % por Pregão (js): | 0,27% | 0,22% |
| % por trade: | 0,049% | |
| Rentabilidade Mensal (js): | 5,48% | |
| Payoff: | 0,95 | |
| Edge: | 4,14% | |
| G/R Efetivo: | 1,18 | |
| Drawdown Máximo: | 12,10% | |
| Expectativa Matemática: | R\$ 2,45 | |
| Índice Sharpe: | 0,08 | |
| Fator de Lucro: | 1,18 | |
| SQN: | 0,68 | |
| ERA: | 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://www.viverdeforex.com/o-guia-definitivo-de-van-tharp-para-medir-a-qualidade-de-um-sistema>