

MM		
Data Início e Fim:	2020-10-07	2021-06-25
#trades positivos:	567	55,9%
#trades negativos:	447	44,1%
#Trades	1014	100,0%
Tempo (dias):	262	3,87 Op/dia
#Pregões e #Op/Pregão:	172	5,90 Op/Pregão
Média \$ por Trade(1):	5.000,00	5.000,00
Lucro dos trades ganhadores:	19.165,00	
Prejuízo dos trades perdedores:	-16.384,00	
Lucro:	2.781,00	
Lucro por Dia:	10,61	
Lucro por Pregão:	16,17	
Lucro dos trade ganhadores / trade:	33,80	0,68%
Prejuízo dos trades perdedores / trade:	-36,65	-0,73%
Maior perda absoluta / trade:	-328,00	
Maior perda relativa / trade:	-6,56%	
% Atual:	55,62%	55,62%
% por Dia:	0,17%	0,17%
% por Pregão:	0,26%	0,26%
% por trade:	0,055%	
Rentabilidade Mensal:	5,27%	
Payoff:	0,92	
G/R Efetivo:	1,17	
Drawdown Máximo:	12,10%	
Expectativa Matemática:	R\$ 2,74	

Índice Sharpe:	0,07
Fator de Lucro:	1,17
SQN:	2,04
ERA:	R\$ 0,07

É necessário refazer os cálculos para normalizar o ganho por contrato.

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>