

Backtest Fül: A Teljesítmény Mutatói

Ez a szekció a stratégia teljesítményének numerikus értékelését adja. Lássuk a legfontosabb metrikákat sorban:

Metrika (Magyar)	Eredeti Név (Angol)	Magyarázat
Teljes nettó profit	Total Net Profit	A legfontosabb mutató. Ez az az összeg, amennyit a stratégiád a tesztidőszak alatt nyert vagy vesztett, már levonva a veszteséges kötések értékét.
Bruttó profit	Gross Profit	Az összes nyereséges kötésből származó profit összege.
Bruttó veszteség	Gross Loss	Az összes veszteséges kötésből származó veszteség összege.
Profit Faktor	Profit Factor	A bruttó profit és a bruttó veszteség aránya ($\text{ProfitFaktor} = \frac{\text{Bruttó Vesztese}}{\text{Bruttó Profit}}$). Egy 1-nél nagyobb érték nyereséges stratégiát jelez. Például egy 2-es érték azt jelenti, hogy minden elvesztett dollárra két dollár nyereség jutott.
Várható érték	Expected Payoff	Egyetlen kötés átlagos várható nyeresége vagy vesztesége. Pozitív érték esetén átlagosan nyereségesek a kötések.
Visszaesés (abszolút és maximális)	Drawdown (Absolute & Maximal)	A tőke csökkenését méri egy korábbi csúcshoz képest. Az abszolút visszaesés a kezdeti tőkéhez viszonyított legnagyobb csökkenést mutatja, míg a maximális visszaesés a tőke bármelyik csúcspontjához képest mért legnagyobb százalékos vagy összegszerű csökkenést jelenti. Ez a stratégia kockázatosságának egyik legfontosabb mutatója.
Helyreállítási faktor	Recovery Factor	A teljes nettó profit és a maximális visszaesés aránya ($\text{HelyreállításiFaktor} = \frac{\text{MaximálisVisszaese}}{\text{TeljesNettó Profit}}$). Megmutatja, hogy a stratégia hányszorosan termelte ki a legnagyobb elszenvedett visszaesést. Minél magasabb, annál jobb.
Sharpe arány	Sharpe Ratio	A stratégia kockázattal korrigált hozamát méri. Minél magasabb az értéke, annál jobb hozamot ért el a stratégia az egységnyi vállalt kockázathoz képest. Általában az 1 feletti értéket már jónak tekintik.
Összes kötés	Total Trades	A tesztidőszak alatt végrehajtott összes kereskedési művelet (vétel és eladás) száma.

Metrika (Magyar)	Eredeti Név (Angol)	Magyarázat
Nyereséges kötések %	Profit Trades %	Az összes kötésen belül a nyereséges kötések százalékos aránya. Bár fontos mutató, önmagában nem minden: egy alacsonyabb találati arányú stratégia is lehet profitábilis, ha a nyerő kötések mértéke sokkal nagyobb, mint a vesztlőké.
Veszteséges kötések %	Loss Trades %	Az összes kötésen belül a veszteséges kötések százalékos aránya.
Legnagyobb nyereséges kötés	Largest Profit Trade	A legnagyobb nyereséget hozó egyedi kötés értéke.
Legnagyobb veszteséges kötés	Largest Loss Trade	A legnagyobb veszteséget okozó egyedi kötés értéke.
Átlagos nyereséges kötés	Average Profit Trade	A nyereséges kötések átlagos értéke.
Átlagos veszteséges kötés	Average Loss Trade	A veszteséges kötések átlagos értéke.
Egymást követő nyerők/vesztők (max.)	Maximal Consecutive Wins/Losses	A leghosszabb nyerő, illetve vesztő széria hossza (kötések számában) és annak összértéke. Ez segít felmérni a stratégia pszichológiai terhelését.