



Backtest #1297 · HOPE · HOPE · GG3_MACD_Momentum (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+2.45%	0.25	33.3%	-18.68%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El ROI de +2.45% parece modesto pero enmascara una estructura deficiente: solo tres operaciones generan una confianza estadística prácticamente nula, haciendo que el Sharpe de 0.25 sea irrelevante matemáticamente. El drawdown del 18.68% es desproporcionadamente alto comparado con el rendimiento, lo que indica que las pérdidas fueron severas y la tasa de acierto del 33% no compensa el riesgo de cola. Aunque HOPE muestra fundamentos sólidos con márgenes expansivos y un P/E atractivo, la estrategia GG3_MACD_Momentum no ha demostrado edge alguno en este contexto de tasa de interés regional. El próximo paso obligatorio es ejecutar un walk-forward analysis con un mínimo de 50 trades para filtrar el ruido y validar si la señal de entrada tiene poder

ADDITIONAL METRICS

CAGR	2.45%
Sortino Ratio	0.20
Turnover	5.75x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10248.45