



Backtest #1920 · LINK/USD · LINK/USD · GG3_MACD_Momentum (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-17.39%	-0.89	0.0%	-18.94%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia GG3_MACD_Momentum en LINK/USD generó un ROI de -17.39% y Sharpe de -0.89, con una tasa de aciertos del 0% sobre solo 4 operaciones. La ausencia total de ganadores invalida cualquier conclusión estadística; el drawdown del 18.94% confirma que el sistema no filtró correctamente las caídas. Con un sample size de 4, la varianza domina el resultado, haciendo los métricas engañosamente pesimistas pero técnicamente correctas para el periodo. No hay señal de edge positivo detectable. El siguiente paso obligatorio es rediseñar los umbrales de entrada para evitar la entrada en tendencias laterales o bajistas, ya que el algoritmo actual opera sin filtro de contexto macro.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-17.39%
Sortino Ratio	-0.58
Turnover	6.96x
Total Trades	4
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$8263.24