



Backtest #29726 · NIC · NIC · GG3\_MACD\_Momentum (auto)

ROI

+9.72%

Sharpe

0.78

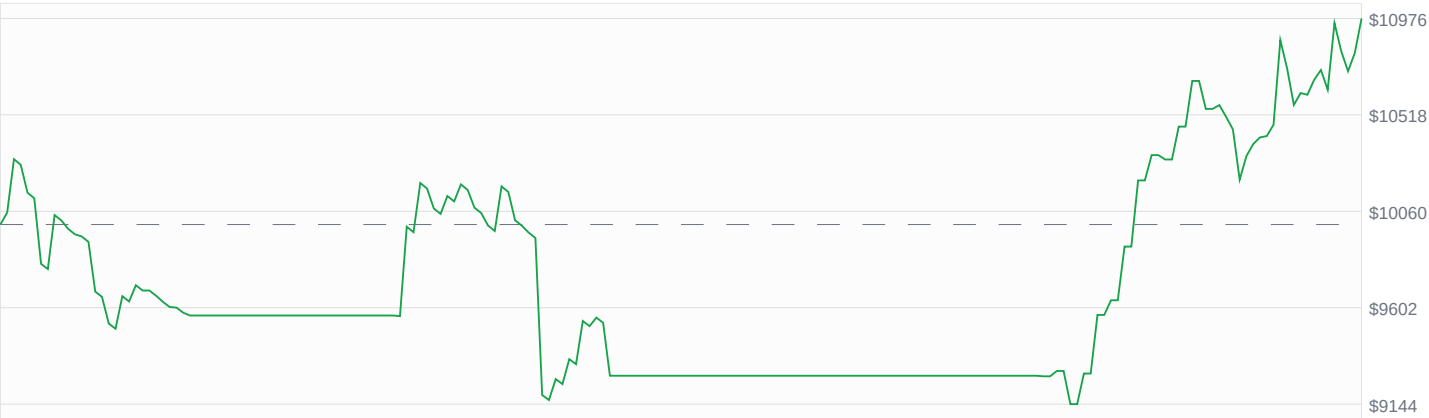
Win Rate

33.3%

Max Drawdown

-10.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El ROI del 9.72% es engañoso porque solo se basa en tres operaciones, lo que invalida cualquier inferencia estadística sobre la robustez de la estrategia. La baja tasa de aciertos del 33.3% y el drawdown del 10.60% sugieren una alta sensibilidad al ruido y una gestión de riesgo ineficiente. Con una muestra tan pequeña, el ratio de Sharpe de 0.78 carece de validez científica y no permite predecir el comportamiento futuro. Es imperativo expandir el universo de datos para obtener al menos cien trades y reducir el error muestral. Solo entonces se podrá evaluar si la estrategia genera alpha real o simplemente ruido estadístico.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 9.72%      |
| Sortino Ratio   | 0.65       |
| Turnover        | 5.87x      |
| Total Trades    | 3          |
| Initial Capital | \$9997.00  |
| Final Capital   | \$10975.78 |