



Backtest #49408 · RDN · RDN · GG3_MACD_Momentum (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-5.59%	-0.31	0.0%	-14.78%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de RDN con la estrategia GG3_MACD_Momentum es un fracaso estadístico no recomendable. Con solo tres operaciones y una tasa de éxito del 0%, los resultados carecen de significado estadístico y reflejan ruido de mercado en lugar de señal robusta. La relación de Sharpe de -0.31 y el máximo drawdown del 14.78% indican una exposición desproporcionada al riesgo sin compensación por rendimiento. La estrategia no funcionó en este periodo específico, probablemente debido a condiciones de mercado contrarias a la momentum. La siguiente acción es aumentar el conjunto de datos para un período más largo y ajustar los filtros de MACD para reducir la sensibilidad a falsos positivos.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-5.59%
Sortino Ratio	-0.25
Turnover	5.88x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9440.84