



Backtest #5023 · MVBF · MVBF · GG3_MACD_Momentum (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+5.46%	0.47	33.3%	-15.05%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia GG3_MACD_Momentum sobre MVBF generó un ROI del +5.46%, pero el Sharpe de 0.47 refleja ajustes insuficientes al riesgo con un drawdown del 15.05%. Con solo 3 operaciones y un win rate del 33.3%, la muestra es estadísticamente insignificante para validar cualquier edge real. La rentabilidad podría deberse a varianza aleatoria más que a lógica de mercado consistente. Se requieren mínimo 30 trades para confirmar significancia y reducir el riesgo de overfitting antes de escalar capital.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	5.46%
Sortino Ratio	0.44
Turnover	5.76x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10549.33