



Backtest #50493 · QCRH · QCRH · GG3_MACD_Momentum (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+11.54%	1.04	100.0%	-5.65%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de QCRH con la estrategia GG3_MACD_Momentum muestra un rendimiento del 11.54% y una tasa de ganancia del 100%, pero un número de operaciones de solo 2 invalida cualquier conclusión estadística sobre la robustez del sistema. La ausencia de pérdidas sugiere una sobreajuste extremo o una falta de exposición al riesgo real, ya que una estrategia sólida debe demostrar consistencia bajo condiciones de mercado adversas. Con un ratio de Sharpe de 1.04, el riesgo ajustado es moderado, pero la baja frecuencia de trades impide evaluar la capacidad del modelo para adaptarse a la volatilidad cambiante. La siguiente acción crítica es ejecutar una nueva simulación con un periodo de tiempo mayor para validar si los resultados son estacionales o

ADDITIONAL METRICS

CAGR	11.54%
Sortino Ratio	1.02
Turnover	4.16x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$11157.75