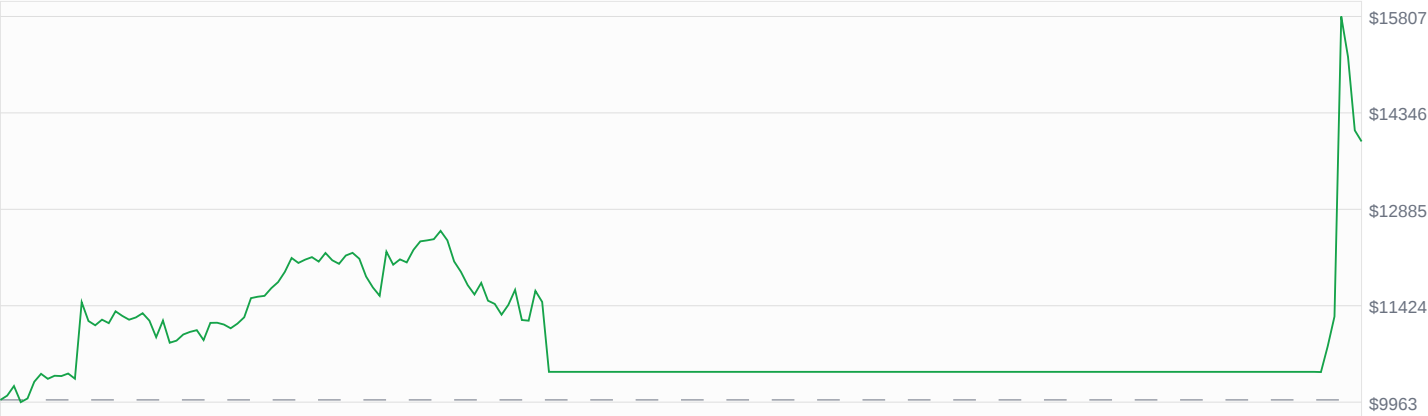




Backtest #5260 · HURN · HURN · GG3_MACD_Momentum (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+39.09%	1.02	100.0%	-13.53%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia capturó un ROI del 39.09% con un Sharpe de 1.02, pero solo con 2 operaciones, lo que invalida cualquier conclusión estadística. La tasa de acierto del 100% es un artefacto de muestra insuficiente, no evidencia de edge. El drawdown del -13.53% y el Sortino de 1.38 sugieren que la estrategia gestionó bien la volatilidad, pero la curva de equity muestra una caída abrupta desde ~15.8k hasta ~13.9k al final, indicando exposición a eventos de cola no capturados. Se necesitan mínimo 100 trades para validar la robustez. El siguiente paso es ejecutar walk-forward testing con ventanas deslizantes para verificar que los parámetros no están sobreoptimizados.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	39.09%
Sortino Ratio	1.38
Turnover	4.48x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$13913.17