



Backtest #52689 · SM · SM · GG3_MACD_Momentum (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+46.62%	1.32	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de SM con GG3_MACD_Momentum muestra una rentabilidad del 46.62% y una tasa de victoria del 100% en dos operaciones, pero esto carece de significancia estadística debido al tamaño de muestra insuficiente. La alta rentabilidad por operación está inflada por un drawdown máximo del 32.83% y un ratio de Sharpe moderado de 1.32, lo que indica volatilidad extrema y falta de robustez en la estrategia. Confiamos poco en estos resultados porque dos operaciones no validan la consistencia del sistema ante condiciones de mercado diversas. Necesitamos ejecutar un test de estrés sobre datos históricos extendidos y aumentar el número de operaciones para filtrar falsas señales de tendencia.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	46.62%
Sortino Ratio	1.02
Turnover	4.98x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14666.15