



Backtest #53818 · CARE · CARE · GG3_MACD_Momentum (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+33.62%	1.69	50.0%	-13.61%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de CARE muestra una ganancia de 33.62% con una relación de Sharpe sólida de 1.69, pero la estrategia enfrenta una limitación crítica por su muestra de solo dos operaciones. Una tasa de acierto del 50% y una pérdida máxima del 13.61% reflejan resultados no concluyentes, ya que la estadística carece de poder suficiente para validar la robustez del indicador GG3_MACD en este activo. La alta volatilidad observada en una ventana tan corta sugiere que los rendimientos actuales podrían ser producto del azar más que de una ventaja consistente. Se requiere ampliar el historial de pruebas para reducir la varianza y confirmar si la señal de momentum genera valor real fuera de condiciones atípicas.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	33.62%
Sortino Ratio	1.48
Turnover	4.33x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$13365.72