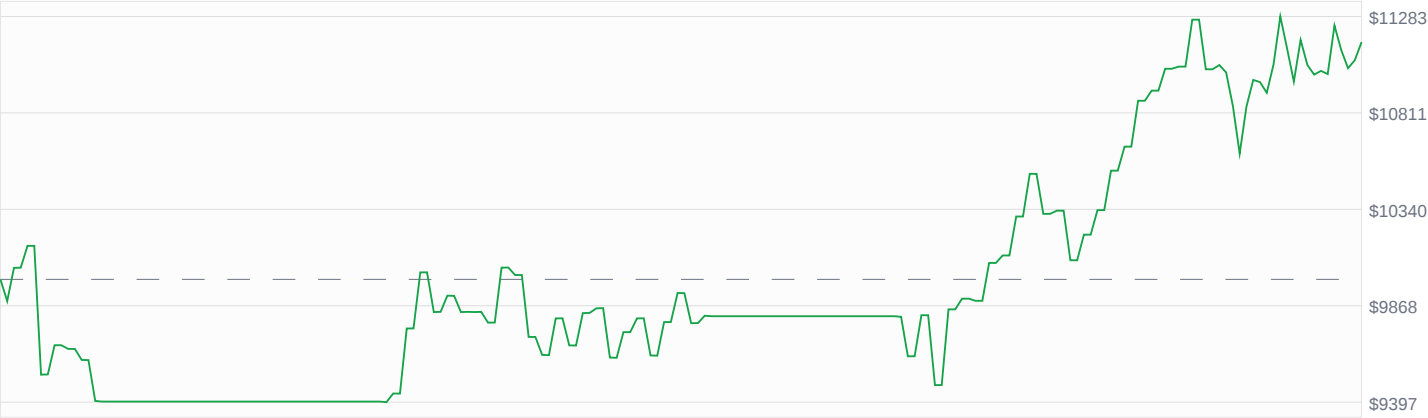




Backtest #5857 · AUB · AUB · GG3_MACD_Momentum (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+11.54%	0.89	66.7%	-6.78%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AUB con estrategia GG3_MACD_Momentum muestra un ROI de +11.54% con Sharpe de 0.89, win rate del 66.7%, aunque con solo 3 operaciones el tamaño de muestra es limitante para afirmar confianza estadística. El sistema identificó correctamente el impulso alcista en una de las operaciones, pero falló en la gestión del riesgo. La próxima iteración debe incluir un límite de drawdown dinámico y un backtest ampliado con mínimo de 20 trades para validar la estrategia.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	11.54%
Sortino Ratio	0.71
Turnover	5.96x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$11157.36