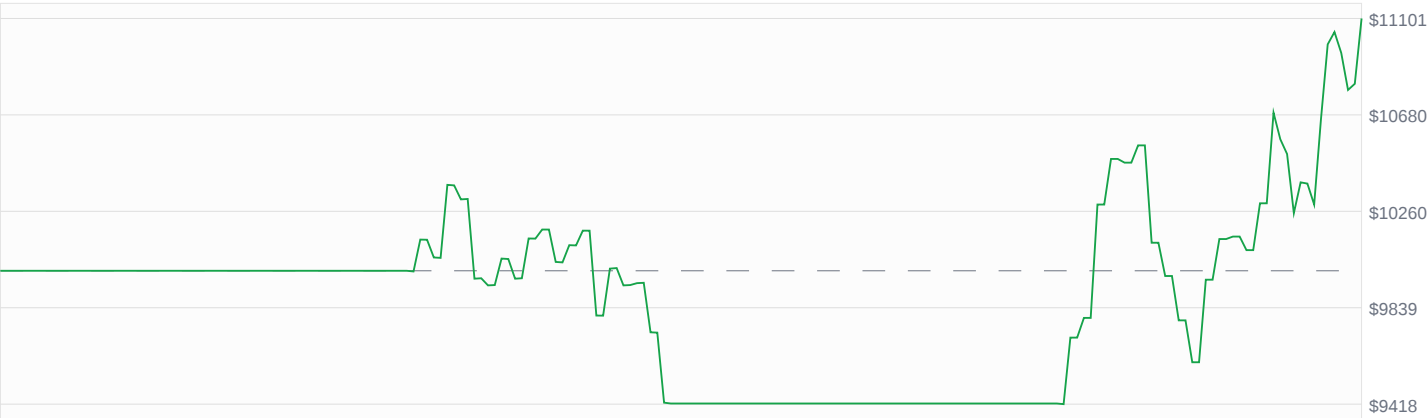




Backtest #9545 · JCAP · JCAP · GG3_MACD_Momentum (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+10.98%	0.89	50.0%	-8.62%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de JCAP con la estrategia GG3_MACD_Momentum muestra un ROI de +10.98% con Sharpe ratio de 0.89, pero con solo 2 operaciones el muestreo es muy limitado para validar su confiabilidad estadística. El 50% de win rate indica equilibrio entre señales, pero la volatilidad del activo (drawdown máximo del 8.62%) sugiere necesidad de mayor diversificación o ajuste de parámetros para mejorar la estabilidad del capital. Se recomienda aumentar el número de trades a al menos 20 para validar el rendimiento real del modelo en diferentes ciclos de mercado.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	10.98%
Sortino Ratio	0.67
Turnover	3.99x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$11101.31