



Backtest #48332 · COF · COF · GG3_MACD_Momentum (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-5.76%	-0.22	25.0%	-19.81%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de COF con la estrategia GG3_MACD_Momentum muestra una ineficiencia operativa severa, evidenciada por un ROI negativo del 5.76% y una tasa de éxito del 25% en solo cuatro operaciones. La relación de Sharpe de -0.22 y una caída máxima del 19.81% indican que la lógica de entrada genera más pérdida que ganancia en este contexto de mercado. Con una muestra tan reducida, cualquier conclusión estadística carece de validez, ya que un evento atípico podría sesgar drásticamente los resultados. Se requiere ampliar el historial de pruebas a al menos 50 operaciones para determinar si la estrategia está intrínsecamente defectuosa o si solo ha fallado en un ciclo de precio específico.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-5.76%
Sortino Ratio	-0.14
Turnover	7.35x
Total Trades	4
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9426.63