



Backtest #48377 · CBAN · CBAN · GG3\_MACD\_Momentum (auto)

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| ROI    | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -2.86% | -0.15  | 50.0%    | -8.25%       |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia CBAN · GG3\_MACD\_Momentum mostró un rendimiento negativo del -2.86% con una relación de Sharpe de -0.15, lo que indica una ineficiencia clara en el riesgo-retorno durante este periodo. Con solo cuatro operaciones ejecutadas, la tasa de victoria del 50% carece de significado estadístico y no permite validar la robustez del modelo. El máximo drawdown del 8.25% sugiere que la gestión de paradas no fue suficiente para proteger el capital ante movimientos adversos. Se requiere aumentar el volumen de datos mediante un backtest extendido o ajustar los parámetros de entrada del MACD para filtrar mejor el ruido.

ADDITIONAL METRICS

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| CAGR            | -2.86%    |
| Sortino Ratio   | -0.08     |
| Turnover        | 7.73x     |
| Total Trades    | 4         |
| Initial Capital | \$9997.00 |
| Final Capital   | \$9717.12 |