



Backtest #48379 · 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 GG3_MACD_Momentum sobre CBAN mostró una ineficiencia severa con un retorno negativo del 2.86% y un ratio de Sharpe de -0.15, indicando que el costo de transacción superó el beneficio neto. La tasa de acierto del 50% con tan solo cuatro operaciones no permite inferir robustez estadística, ya que la muestra es insuficiente para validar la fiabilidad del modelo frente al ruido del mercado. El máximo retroceso del 8.25% sugiere una falta de resiliencia en la gestión de riesgo durante las correcciones, lo que impide la conservación de capital en escenarios de lateralización. Ante la escasez de señales de alta calidad, se requiere ajustar los umbrales del MACD para filtrar el ruido o reducir el tamaño de posición para mitigar la

ADDITIONAL METRICS

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