



Backtest #53382 · COF · COF · GG5_Stochastic_Oversold (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 la estrategia COF muestra una ineficiencia operativa crítica, con un retorno negativo del 5.76% y una tasa de éxito del 25% sobre solo cuatro operaciones. Un drawdown máximo del 19.81% indica que el filtro de estocástico sobrevendido capturó movimientos de tendencia bajista sin protección adecuada. La relación de Sharpe de -0.22 confirma que el riesgo asumido no generó recompensa suficiente estadísticamente, lo que sugiere una incapacidad del modelo para filtrar ruido de mercado en este activo. Dada la muestra insuficiente de eventos, cualquier conclusión sobre la robustez de la lógica se considera altamente especulativa y no validada. La siguiente acción prioritaria es ajustar los parámetros del estocástico para evitar entradas en

ADDITIONAL METRICS

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