



Backtest #27977 · FANG · FANG · GG4_Bollinger_Squeeze (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+6.85%	0.44	25.0%	-15.96%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia presenta un Sharpe de 0.44 y un drawdown máximo del 15.96% sobre solo cuatro operaciones, lo que invalida cualquier inferencia estadística significativa. Aunque el ROI es positivo, la tasa de aciertos del 25% y el tamaño de muestra insuficiente sugieren que el rendimiento se debe al azar más que a un edge real. Es imperativo aumentar el volumen de datos para validar la robustez del modelo antes de cualquier consideración de capital. Se recomienda expandir el periodo de backtest a múltiples ciclos de mercado para reducir la varianza y confirmar la consistencia del alpha.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	6.85%
Sortino Ratio	0.40
Turnover	8.17x
Total Trades	4
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10688.04