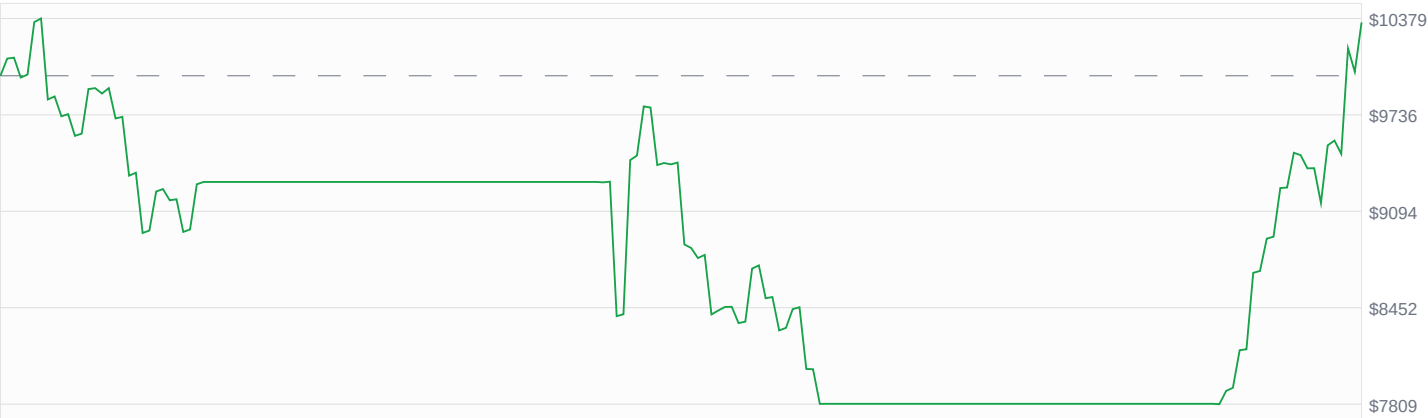




Backtest #35798 · HCC · HCC · GG4_Bollinger_Squeeze (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+3.50%	0.29	33.3%	-24.76%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de HCC con la estrategia GG4_Bollinger_Squeeze muestra una rentabilidad positiva del 3.50%, pero los indicadores estadísticos revelan una falta de robustez crítica. Un ratio Sharpe de 0.29 y una tasa de ganancia del 33.3% sugieren que la estrategia no supera consistentemente al riesgo de mercado. La profundidad de la pérdida máxima del 24.76% contrasta peligrosamente con solo tres operaciones ejecutadas, lo que indica una inestabilidad extrema y una falta de significancia estadística. La baja frecuencia de trades impide confirmar la viabilidad a largo plazo y deja abiertas las dudas sobre la capacidad del filtro de squeezes en este activo específico. El siguiente paso lógico es expandir la muestra de datos a un periodo más amplio

ADDITIONAL METRICS

CAGR	3.50%
Sortino Ratio	0.18
Turnover	5.46x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10352.99