



Backtest #40239 · ESNT · ESNT · GG4_Bollinger_Squeeze (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+13.44%	1.15	100.0%	-7.08%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de ESNT con la estrategia GG4_Bollinger_Squeeze muestra un rendimiento atractivo con un ROI del 13.44% y un Sharpe de 1.15, aunque el win rate del 100% es sospechoso dada la muestra de solo 2 operaciones, lo cual reduce la confiabilidad estadística. El máximo drawdown del 7.08% indica cierto riesgo de volatilidad, pero la estrategia no se mostró robusta en este periodo corto. La falta de diversificación y la escasa cantidad de trades limitan la capacidad de generalización. Se recomienda validar la estrategia en un periodo más largo con más muestras de trades antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	13.44%
Sortino Ratio	0.88
Turnover	4.17x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$11347.26