



Backtest #5398 · PEPE/USD · PEPE/USD · GG5_Stochastic_Oversold (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-43.79%	-2.22	33.3%	-47.27%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia GG5 en PEPE/USD generó un ROI de -43.79% con un Sharpe de -2.22, evidenciando una destrucción de capital severa y alta volatilidad. Con solo 3 operaciones y un win rate del 33.3%, la muestra es estadísticamente insignificante para extrapolar viabilidad. El drawdown del 47.27% confirma que la estrategia no gestiona adecuadamente la extensión del activo. Se requiere un backtest con al menos 100 trades para validar cualquier hipótesis. El siguiente paso es aumentar el periodo de prueba y revisar los parámetros de entrada para reducir el riesgo por operación.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-43.79%
Sortino Ratio	-1.24
Turnover	4.00x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$5622.57