



Backtest #7390 · XTZ/USD · XTZ/USD · GG5\_Stochastic\_Oversold (auto)

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -34.76% | -1.40  | 0.0%     | -39.09%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de XTZ/USD con la estrategia GG5\_Stochastic\_Oversold muestra un rendimiento negativo sólido, con un ROI del -34.76% y un Ratio de Sharpe de -1.40, lo que indica una gestión de riesgo deficiente y pérdidas consistentes. La tasa de aciertos del 0.0% en solo tres operaciones sugiere que el modelo no está capturando las reversales alcistas esperadas del estocástico en zonas de sobreventa, posiblemente debido a la fuerte tendencia bajista del activo durante el periodo analizado. La caída máxima del 39.09% refuerza la falta de filtros de tendencia adecuados, permitiendo entradas contra el flujo del mercado. Dada la pequeña muestra de tres transacciones, la estadística carece de significancia robusta, pero la dirección es

ADDITIONAL METRICS

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| CAGR            | -34.76%   |
| Sortino Ratio   | -0.69     |
| Turnover        | 4.44x     |
| Total Trades    | 3         |
| Initial Capital | \$9997.00 |
| Final Capital   | \$6524.13 |