



Backtest #50612 · MET · MET · GG4_Bollinger_Squeeze (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+17.26%	1.27	50.0%	-6.62%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de MET con la estrategia de Bollinger Squeeze muestra un rendimiento bruto del 17.26% y una relación de Sharpe de 1.27, aunque una tasa de victoria del 50% indica que la dirección no es un predictor superior. La fiabilidad estadística es extremadamente baja debido a solo dos operaciones ejecutadas, lo que hace que los resultados sean altamente sensibles a la varianza de una sola ejecución y no representativos del desempeño real. Aunque la máxima caída del 6.62% sugiere una gestión de riesgo funcional, la muestra insuficiente impide validar la robustez de la estrategia ante diferentes condiciones de mercado. El siguiente paso crítico es ejecutar un análisis de estrés extendido en al menos 500 operaciones simuladas para confirmar si

ADDITIONAL METRICS

CAGR	17.26%
Sortino Ratio	1.07
Turnover	4.06x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$11729.59