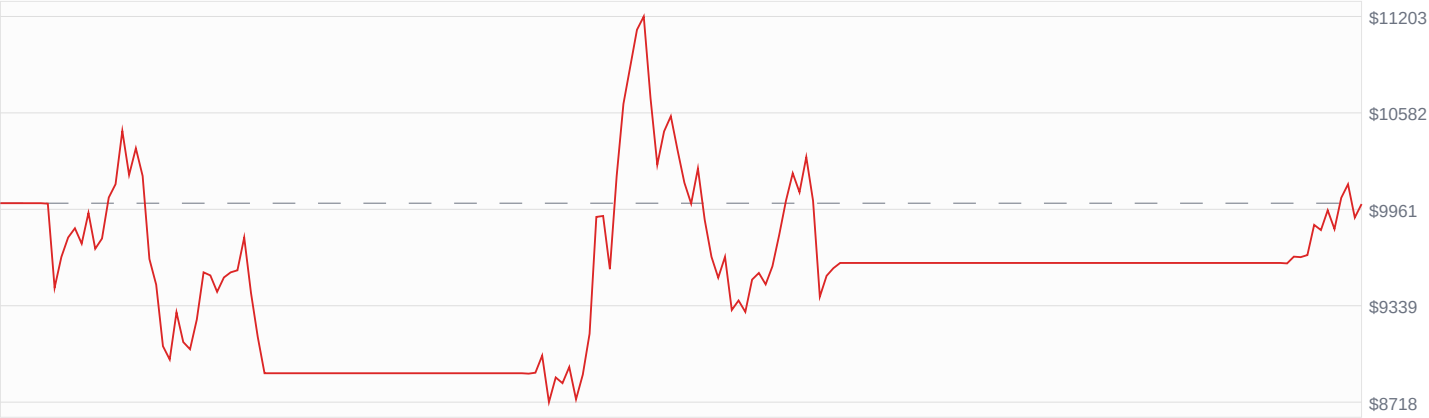




Backtest #50727 · DEC · DEC · GG5_Stochastic_Oversold (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-0.08%	0.13	66.7%	-16.99%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de DEC en la estrategia GG5_Stochastic_Oversold muestra un rendimiento negativo del -0.08% con una ratio Sharpe de 0.13, lo que indica una ineficiencia clara en la gestión del riesgo. Aunque la tasa de ganancia del 66.7% parece prometedora, la muestra de solo tres operaciones carece de potencia estadística para validar la robustez del modelo frente al drawdown del 16.99%. La estrategia falló al no proteger el capital durante las correcciones, resultando en una pérdida real de capital en un mercado lateral o bajista. Se requiere ampliar el periodo de prueba a al menos 200 operaciones para determinar si el umbral del estocástico está calibrado adecuadamente para este activo.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-0.08%
Sortino Ratio	0.08
Turnover	5.70x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9994.54