



Backtest #55083 · HCC · HCC · GG4_Bollinger_Squeeze (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-0.79%	0.11	33.3%	-24.76%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia GG4_Bollinger_Squeeze en HCC mostró un rendimiento negativo del -0.79% con una tasa de ganancias del 33.3% en solo tres operaciones, lo que indica una ineficacia crítica bajo el régimen de mercado actual. Con un ratio Sharpe de 0.11 y una caída máxima del 24.76%, la falta de señales robustas sugiere que el rango de compresión no ha generado la volatilidad necesaria para activar los umbrales de entrada. La muestra de tres operaciones es estadísticamente insuficiente para confirmar la viabilidad del modelo, resultando en conclusiones prematuras sobre la calidad del algoritmo. Se recomienda ejecutar un backtest extensivo en datos históricos de mayor profundidad para evaluar la resiliencia de la lógica de

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-0.79%
Sortino Ratio	0.07
Turnover	5.37x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9924.15