



Backtest #55645 · CPAY · CPAY · GG4_Bollinger_Squeeze (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+27.63%	1.03	50.0%	-18.47%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia CPAY · GG4_Bollinger_Squeeze generó un retorno del 27.63% con una tasa de Sharpe de 1.03, pero la validez estadística es nula debido a solo dos operaciones ejecutadas. Un drawdown máximo del 18.47% indica riesgo significativo en periodos de volatilidad, mientras que la tasa de acierto del 50% sugiere que las ganancias no provienen de consistencia sino de asimetría en las pocas posiciones exitosas. Con una muestra tan limitada, cualquier conclusión sobre la robustez del filtro de Bollinger sería prematura y carecería de confiabilidad para decisiones institucionales. El siguiente paso crítico es ampliar el historial de pruebas para al menos 100 operaciones antes de validar el sistema en capital real.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	27.63%
Sortino Ratio	1.03
Turnover	4.18x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$12766.78