



Backtest #40674 · PEPE/USD · PEPE/USD · GG5_Stochastic_Oversold (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-43.79%	-2.22	33.3%	-47.27%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de PEPE/USD muestra una ineficiencia crítica con un ROI negativo y una caída máxima del 47%, indicando que la estrategia GG5_Stochastic_Oversold captura solo movimientos de retroceso sin proteger capital. Con solo tres operaciones, los estadísticos de Sharpe y la tasa de aciertos carecen de significancia empírica, revelando una alta volatilidad en lugar de una señal robusta. La lógica de entrada parece fallar ante la naturaleza especulativa del activo, requiriendo filtros de volumen o confirmación de tendencia antes de operar. El siguiente paso inmediato es reducir la frecuencia de señales hasta obtener una muestra de al menos cincuenta operaciones para validar la viabilidad del sistema.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-43.79%
Sortino Ratio	-1.24
Turnover	4.00x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$5622.57