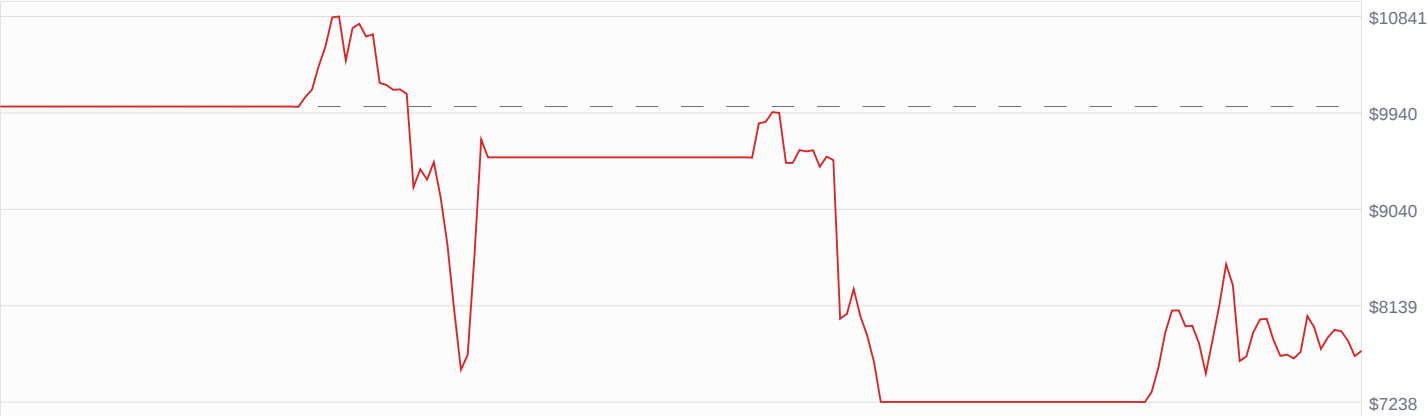




Backtest #48329 · DFIN · DFIN · GG4_Bollinger_Squeeze (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-22.85%	-0.65	33.3%	-33.24%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia GG4_Bollinger_Squeeze en DFIN ha fallado estructuralmente, registrando un ROI negativo del -22.85% y una caída máxima del 33.24% con solo tres operaciones. Una tasa de acierto del 33.3% y un ratio de Sharpe de -0.65 indican que el ruido del mercado superó la señal del apretón de Bollinger, lo que sugiere una falta de robustez estadística en este tamaño de muestra. Con tan pocos intentos, los resultados carecen de poder predictivo para un despliegue institucional real, ya que un evento atípico podría distorsionar completamente el rendimiento. Se requiere ampliar el historial de pruebas o ajustar los parámetros de entrada para filtrar mejor las condiciones de volatilidad en este activo específico.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-22.85%
Sortino Ratio	-0.38
Turnover	5.13x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$7717.78