



Backtest #55419 · HOMB · HOMB · GG4_Bollinger_Squeeze (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+8.00%	0.78	50.0%	-8.42%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de la estrategia de compresión de Bollinger en HOMB muestra un retorno del 8% con un ratio de Sharpe bajo de 0.78, lo que indica que las ganancias no compensan adecuadamente el riesgo asumido. La tasa de éxito del 50% y el máximo bajón del 8.42% sugieren una falta de consistencia y una exposición significativa a la volatilidad en un solo periodo. Con solo dos operaciones registradas, la muestra es estadísticamente insuficiente para afirmar la robustez del modelo ante diferentes condiciones de mercado. Se requiere ejecutar una prueba con mayor frecuencia temporal o en otros activos para validar si el mecanismo de señal es funcional antes de considerarlo operativo. No se recomienda desplegar capital real hasta obtener un historial de

ADDITIONAL METRICS

CAGR	8.00%
Sortino Ratio	0.60
Turnover	4.02x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$10799.92