



Backtest #41127 · FIL/USD · FIL/USD · GG5_Stochastic_Oversold (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-2.99%	0.05	50.0%	-29.98%

EQUITY CURVE119 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de FIL/USD con la estrategia GG5_Stochastic_Oversold presenta una ineficacia crítica, registrando una pérdida del 2.99% y un máximo de caída del 29.98% sobre una muestra estadísticamente insostenible de solo dos operaciones. Una tasa de acierto del 50% y un ratio de Sharpe de 0.05 indican ausencia de valor alfa, lo que sugiere que el umbral de sobreventa utilizado no filtra adecuadamente los movimientos adversos del mercado. La baja frecuencia de operaciones impide determinar la robustez del modelo ante condiciones de mercado diversas, limitando cualquier conclusión sobre su viabilidad operativa a largo plazo. Se requiere aumentar el tamaño de muestra mediante simulaciones en múltiples intervalos temporales y condiciones de

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-4.43%
Sortino Ratio	0.04
Turnover	6.01x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9700.56