



Backtest #45308 · IBRX · IBRX · GG7_Williams_Oversold (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-22.74%	-0.97	25.0%	-29.23%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia de reversión en sobreventa sobre IBRX falló estrepitosamente, generando una pérdida del 22.74% y un ratio Sharpe negativo de 0.97. Con solo cuatro operaciones, el resultado carece de poder estadístico para validar cualquier conclusión sobre la robustez del modelo. La tasa de éxito del 25% y un máximo de caída del 29.23% indican que la señal de Williams %R no filtró adecuadamente las condiciones de tendencia bajista. Se debe ampliar el historial de pruebas y evaluar filtros de tendencia para evitar entrar en mercados alcistas.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-22.74%
Sortino Ratio	-0.61
Turnover	6.81x
Total Trades	4
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$7728.75