



Backtest #48870 · UMBF · UMBF · GG7\_Williams\_Oversold (auto)

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +15.35% | 1.13   | 50.0%    | -6.13%       |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de UMBF usando el oscilador Williams %R muestra una ganancia neta del 15.35% con una baja volatilidad y un máximo de caída del 6.13%, pero la estrategia solo procesó dos operaciones. Una tasa de éxito del 50% con tan pocas muestras carece de significancia estadística, lo que impide confirmar la robustez del modelo ante condiciones de mercado cambiantes. Aunque el ratio de Sharpe de 1.13 sugiere una relación riesgo-rentable, la falta de datos históricos hace que los resultados actuales sean altamente sensibles a condiciones de sobreventa específicas y poco fiables para escalar. La siguiente acción crítica es ampliar el periodo de prueba a al menos 100 operaciones para determinar si el 50% de aciertos es un patrón

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 15.35%     |
| Sortino Ratio   | 0.93       |
| Turnover        | 4.01x      |
| Total Trades    | 2          |
| Initial Capital | \$9997.00  |
| Final Capital   | \$11538.91 |