



Backtest #31664 · MSFT · GG7\_Williams\_Oversold

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -17.07% | -1.36  | 33.3%    | -19.93%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de MSFT con la estrategia GG7\_Williams\_Oversold revela un rendimiento negativo del -17.07% con una ratio de Sharpe de -1.36, lo que indica una falta de capacidad de generación de alpha. La baja tasa de ganancia del 33.3% y un número insuficiente de operaciones (solo 3) limitan la confianza estadística del resultado. El máximo drawdown del 19.93% indica alta volatilidad y riesgo. La estrategia presenta un riesgo sistémico elevado y un rendimiento deficiente en este periodo de prueba. Una siguiente iteración debe enfocarse en aumentar el número de operaciones mediante una ventana de tiempo más amplia y un análisis de sensibilidad para ajustar los parámetros de entrada.

ADDITIONAL METRICS

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| CAGR            | -17.07%   |
| Sortino Ratio   | -0.82     |
| Turnover        | 5.30x     |
| Total Trades    | 3         |
| Initial Capital | \$9997.00 |
| Final Capital   | \$8295.86 |