



Backtest #52456 · UMBF · UMBF · GG7_Williams_Oversold (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+10.96%	0.83	50.0%	-9.29%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de UMBF con Williams %R muestra un ROI positivo del 10.96% y un drawdown controlado del 9.29%, pero la estrategia carece de validez estadística debido a solo dos operaciones. Un ratio de Sharpe de 0.83 sugiere una rentabilidad ajustada al riesgo mediocre, mientras que una tasa de acierto del 50% no ofrece una ventaja clara sobre la aleatoriedad. La muestra es insuficiente para confirmar la robustez del indicador en este activo, lo que requiere validar el comportamiento con un historial más amplio. Se recomienda ejecutar una nueva simulación con mayor intervalo de tiempo para evaluar la consistencia de las señales en diferentes regímenes de mercado.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	10.96%
Sortino Ratio	0.67
Turnover	3.98x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$11099.06