



Backtest #8013 · 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

La muestra de dos operaciones carece completamente de significancia estadística, por lo que un Sharpe de 0.05 y un ROI negativo son ruido, no señal. Sin embargo, un drawdown del 29.98% con capital inicial de \$10,000 es extremadamente preocupante, sugiriendo un riesgo de posición descontrolado a pesar de la baja frecuencia. La tasa de aciertos del 50% no compensa la magnitud de las pérdidas, indicando que los filtros de entrada no discriminan calidad. No se puede extraer confianza alguna de este dataset; la estrategia es estadísticamente inválida hasta ahora. El siguiente paso crítico es auditar el tamaño de posición y aumentar el período de backtest para obtener una muestra mínima de 30 trades antes de cualquier conclusión.

ADDITIONAL METRICS

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