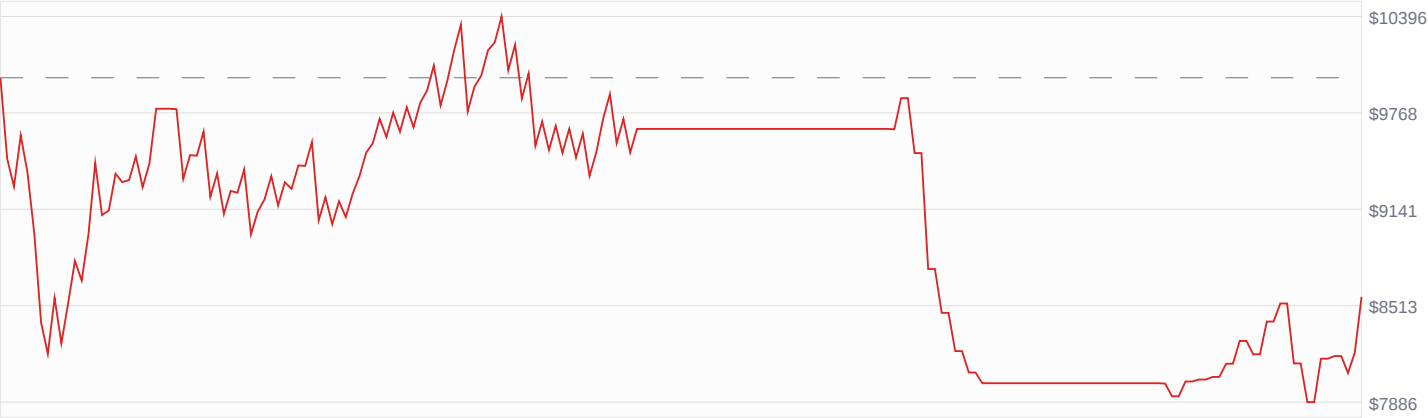




Backtest #53682 · TNK · TNK · GG7_Williams_Oversold (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-14.31%	-0.46	25.0%	-24.15%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia TNK GG7 Williams Oversold falló catastróficamente con un ROI negativo y una tasa de ganancias del 25%, indicando que la señal de sobreventa no capturó la dirección de mercado en este conjunto de datos. Con solo cuatro operaciones, la muestra es estadísticamente insostenible para inferir viabilidad, y la alta volatilidad sugirió que los niveles de soporte fueron vulnerados rápidamente. El drawdown máximo del 24.15% revela una falta de protección suficiente contra movimientos adversos en el crudo. La baja relación de Sharpe confirma que el riesgo superó ampliamente cualquier retorno marginal. El siguiente paso obligatorio es reducir el tamaño de lote o ajustar el umbral de activación para filtrar entradas de menor calidad.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-14.31%
Sortino Ratio	-0.29
Turnover	7.35x
Total Trades	4
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8571.26