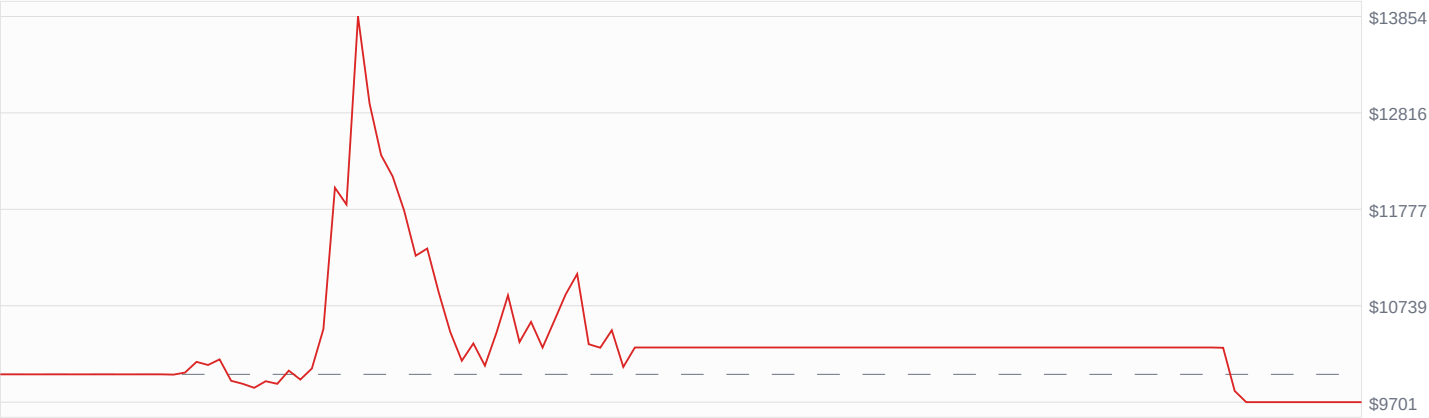




Backtest #53796 · FIL/USD · FIL/USD · GG5_Stochastic_Oversold (auto)

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

El backtest de FIL/USD con la estrategia GG5 Stochastic Oversold muestra una ineficacia operativa significativa, evidenciada por una pérdida del 2.99% y una relación riesgo-rendimiento de Sharpe de apenas 0.05. La estrategia falló al capturar solo dos operaciones en el periodo simulado, lo que genera una alta incertidumbre estadística y hace imposible validar la robustez de los parámetros actuales. El máximo retroceso del 29.98% indica una exposición desproporcionada al riesgo sin mecanismos de protección adecuados en un tamaño de muestra insuficiente. Considerando la baja rentabilidad y el alto drawdown, el siguiente paso lógico es ampliar el periodo de prueba o ajustar los filtros de entrada para reducir la tasa de pérdidas

ADDITIONAL METRICS

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