



Backtest #41311 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v1566

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+41.20%	1.21	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1566 sobre SM muestra un ROI del 41.20% con una tasa de ganancia del 100%, pero esta métrica carece de valor estadístico al basarse únicamente en dos operaciones. Un drawdown máximo del 32.83% indica una exposición de riesgo extrema que no se mitiga con la rentabilidad aparente. Dada la muestra insuficiente, no es posible validar la robustez del modelo ni confiar en su ratio de Sharpe actual. Se requiere ejecutar una simulación con parámetros ajustados para generar un historial de al menos 100 operaciones antes de cualquier despliegue real.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	41.20%
Sortino Ratio	0.94
Turnover	4.92x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14124.38