



Backtest #46767 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v87

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 EVO_GG1RSISNIP_v87 muestra una rentabilidad del 41.20% con una tasa de éxito del 100%, pero esta métrica carece de confianza estadística debido a un volumen de muestra insuficiente de solo dos operaciones. Un drawdown máximo del 32.83% indica una exposición extrema al riesgo que contradice la apariencia de eficiencia en la relación Sharpe de 1.21. La estrategia parece sobreajustada a condiciones específicas del activo SM, lo que la hace frágil ante cambios en la volatilidad del mercado. Se debe ejecutar una prueba de robustez ampliando el horizonte temporal y probando en al menos diez activos correlativos antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

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