



Backtest #47076 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v906

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 muestra una ganancia del 41.20% con una tasa de ganancia perfecta del 100%, pero esta métrica es estadísticamente irrelevante al solo registrar dos operaciones. Una caída máxima del 32.83% indica una gestión de riesgo extrema y poco realista para un entorno de mercados líquido. La baja relación de Sharpe (1.21) sugiere que la rentabilidad no es eficiente dado el nivel de volatilidad experimentada. Se requiere ampliar el período de prueba y probar en datos fuera de muestra para validar la robustez de la estrategia.

ADDITIONAL METRICS

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