



Backtest #48096 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v972

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_v972 sobre SM muestra un retorno del 41.2% con una tasa de ganancia perfecta del 100%, pero el tamaño muestral de dos operaciones es insuficiente para validar la robustez estadística del modelo. La relación de Sharpe de 1.21 indica un rendimiento ajustado al riesgo aceptable, aunque el máximo retroceso del 32.83% revela una exposición significativa a la volatilidad durante periodos de baja liquidez. La ausencia de pérdidas en este escenario limitado sugiere que la estrategia podría estar sobre-optimizada o simplemente haber capturado un movimiento excepcional en lugar de una tendencia estructural. Se recomienda ejecutar un estudio de estrés extendido en periodos de alta volatilidad para determinar si el

ADDITIONAL METRICS

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