



Backtest #48654 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v1090

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 SM muestra un ROI del +41.20% y una tasa de ganancia del 100% en solo dos operaciones, pero la muestra es demasiado pequeña para confiar en la robustez estadística de la estrategia. Aunque el ratio de Sharpe de 1.21 sugiere gestión de riesgo aceptable, un máximo de caída del 32.83% indica una exposición significativa al riesgo en cada posición. La falta de diversidad en los datos hace que cualquier conclusión sobre el rendimiento sea altamente especulativa y no representativa de condiciones de mercado reales. Se requiere ampliar el historial de pruebas o ajustar los parámetros para generar suficientes operaciones y validar la consistencia del modelo antes de cualquier despliegue.

ADDITIONAL METRICS

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