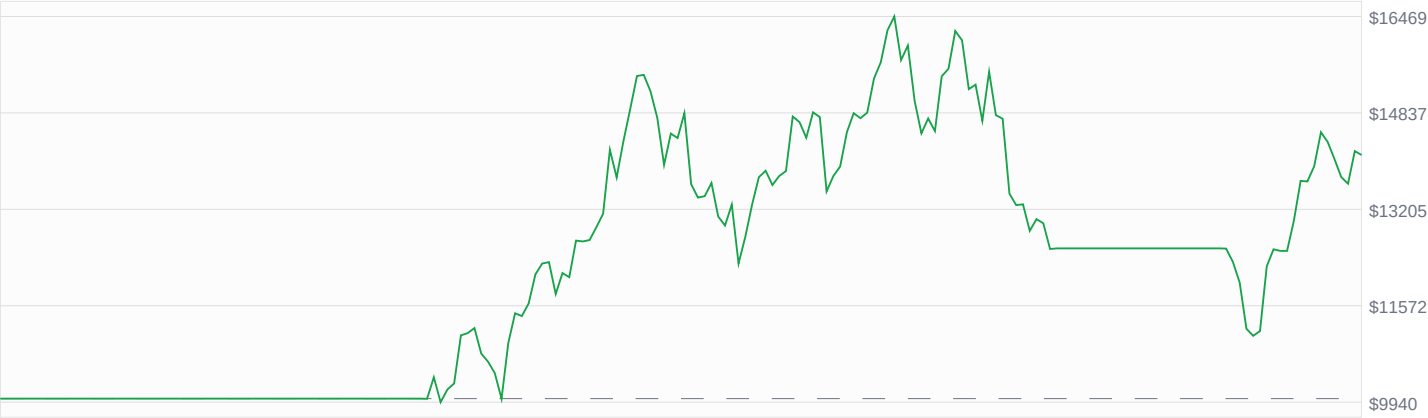




Backtest #48758 · SM · EVO\_GG1RSISNIP\_v1109

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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 para EVO\_GG1RSISNIP\_v1109 muestra una rentabilidad del 41.20% y una tasa de ganancia del 100% en solo dos operaciones. Sin embargo, la estadística es irrelevante debido a la muestra mínima, lo que invalida la confiabilidad de la alta tasa de éxito. El riesgo de caída del 32.83% indica una exposición extrema a un par de movimientos adversos que podrían haber destruido el capital. Con una relación de Sharpe de 1.21, la eficiencia del riesgo no se justifica por la volatilidad implícita en tan pocos datos. La acción inmediata es ejecutar un backtest robusto con al menos 100 operaciones 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 |