



Backtest #49051 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v1168

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 una rentabilidad del 41.2% y una tasa de ganancia del 100%, pero solo en dos operaciones. Esta perfección estadística carece de confianza significativa debido al tamaño de muestra insuficiente, lo que invalida la robustez de la estrategia. Un drawdown del 32.83% indica una exposición al riesgo extrema no validada por datos históricos más amplios. El ratio de Sharpe de 1.21 sugiere un rendimiento ajustado al riesgo decente, pero es engañoso sin más pruebas de estrés. La siguiente acción es ejecutar una prueba de estrés en diferentes mercados para validar la consistencia antes de desplegar capital real.

ADDITIONAL METRICS

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