



Backtest #49816 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v1242

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_v1242 sobre SM muestra una rentabilidad bruta del 41.20% y una tasa de ganancia del 100% en solo dos operaciones, lo que indica una alta eficiencia pero una falta crítica de datos estadísticos. La ausencia de pérdidas en una muestra tan pequeña no valida la robustez de la estrategia, ya que el ratio de Sharpe de 1.21 y el máximo retroceso del 32.83% no reflejan el comportamiento real ante volatilidad extendida. La señal se basa en un evento único o una condición extrema no replicable, lo que genera una confianza estadística insostenible para decisiones institucionales. Se requiere ejecutar al menos 100 simulaciones con parámetros perturbados para determinar si la rentabilidad es un artefacto de sobreajuste o una

ADDITIONAL METRICS

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