



Backtest #50006 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v257

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_v257 muestra un retorno del 41.20% y una tasa de ganancia del 100% en solo dos operaciones, lo que indica una señal de alta calidad pero carece de confianza estadística debido al tamaño de muestra insuficiente. La relación de Sharpe de 1.21 sugiere una eficiencia de riesgo aceptable, aunque la caída máxima del 32.83% revela una exposición al riesgo significativa que no se ha probado en mercados laterales o bajistas. La estrategia funcionó en este escenario específico sin generar pérdidas, pero la falta de datos históricos robustos impide validar su robustez ante condiciones de mercado cambiantes. Se requiere ejecutar un nuevo backtest con un mayor rango de fechas o ajustar los parámetros de

ADDITIONAL METRICS

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