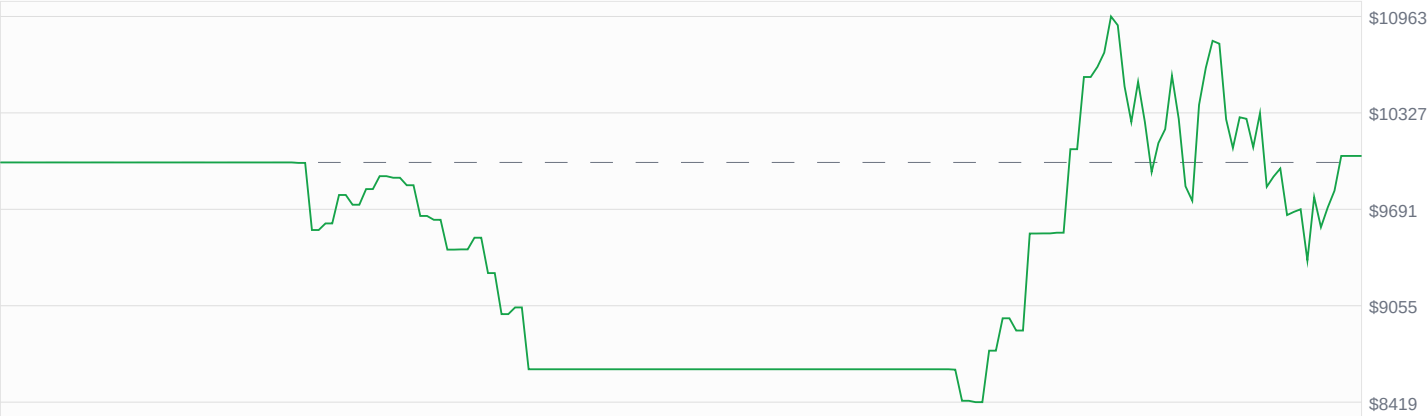




Backtest #51479 · PLMR · EVO_GG1RSISNIP_v1586

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+0.43%	0.14	50.0%	-14.67%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de PLMR con EVO_GG1RSISNIP_v1586 muestra un ROI marginal del 0.43% y una tasa de ganancia del 50%, lo que indica una estrategia ineficaz en este contexto específico. Con solo dos operaciones registradas, los resultados carecen de significancia estadística y no permiten validar la robustez del modelo ante volatilidad futura. Un drawdown máximo del 14.67% sugiere que la gestión de riesgo actual es demasiado agresiva para un perfil conservador. La baja relación de Sharpe de 0.14 confirma que el rendimiento no compensa adecuadamente el riesgo asumido. El siguiente paso lógico es ejecutar un nuevo backtest ajustando el tamaño de posición para reducir el drawdown y probar en un periodo más amplio.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	0.43%
Sortino Ratio	0.10
Turnover	3.73x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$10042.90