



Backtest #51497 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v423

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+43.36%	1.26	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de SM con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v423 muestra una rentabilidad del 43.36% y una tasa de ganancia del 100%, pero solo con dos operaciones, lo que genera una señal estadística extremadamente débil y poco confiable. A pesar de la alta rentabilidad, un drawdown máximo del 32.83% indica un riesgo de volatilidad severo que no se mitiga con la muestra tan reducida de datos. El ratio de Sharpe de 1.26 sugiere un rendimiento ajustado al riesgo decente, pero es insignificante al no poder validar la consistencia del modelo fuera de esta muestra anecdótica. No podemos confirmar la robustez de la estrategia sin ampliar el periodo histórico o el conjunto de datos probatorio. La siguiente acción crítica es ejecutar un backtest extendido

ADDITIONAL METRICS

CAGR	43.36%
Sortino Ratio	0.97
Turnover	4.94x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14340.32