



Backtest #46658 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v890

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

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v890 sobre SM mostró un retorno del 41.2% con una tasa de ganancia perfecta del 100% en dos operaciones, pero una caída máxima del 32.8% revela una exposición extrema a la varianza. Un ratio de Sharpe de 1.21 sugiere eficiencia ajustada al riesgo moderada, aunque la muestra de dos operaciones es insuficiente para validar la robustez del modelo ante condiciones de mercado cambiantes. La confianza estadística es nula con tan pocos datos, por lo que cualquier conclusión sobre su viabilidad a largo plazo sería especulativa sin más validación. El siguiente paso crítico es ejecutar un backtest extendido con al menos 500 operaciones para determinar si este desempeño es consistente o una anomalía de sobreajuste.

ADDITIONAL METRICS

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