



Backtest #46847 · SM · EVO\_GG1RSISNIP\_v237

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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 la estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v237 sobre SM muestra un retorno de +41.20% y una tasa de victoria perfecta del 100%, pero estos resultados carecen de valor estadístico al basarse únicamente en dos operaciones. La relación de Sharpe de 1.21 sugiere eficiencia, aunque la caída máxima del 32.83% indica que la estrategia tolera riesgos elevados durante ajustes de mercado. La falta de datos suficientes impide validar la robustez del modelo frente a condiciones de mercado variables. Para avanzar, se requiere ejecutar un backtest con mayor frecuencia temporal o en múltiples activos para confirmar la consistencia de la señal.

ADDITIONAL METRICS

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