



Backtest #49062 · NVDA · EVO_GG1RSISNIP_v1170

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-0.63%	0.09	33.3%	-23.49%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de EVO_GG1RSISNIP_v1170 en NVDA muestra una ineficiencia operativa crítica, con un ROI negativo del -0.63% y una tasa de éxito del 33.3% que indica una estrategia de alta pérdida. La relación de Sharpe de 0.09 confirma una rentabilidad ajustada al riesgo casi nula, mientras que un máximo de caída del 23.49% expone un perfil de riesgo intolerable para capital institucional. Con solo tres operaciones en la muestra, los resultados carecen de potencia estadística, lo que invalida cualquier conclusión sobre la robustez del sistema más allá de la pura desventaja. La siguiente acción imperativa es ajustar los filtros de entrada para eliminar las pérdidas de margen y ejecutar una validación en un período temporal más extenso para obtener

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-0.63%
Sortino Ratio	0.08
Turnover	6.21x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9939.83