



Backtest #49172 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v1219

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 SM con EVO_GG1RSISNIP_v1219 muestra una rentabilidad del 41.20% y una tasa de ganancia del 100%, pero con solo dos operaciones la señal estadística es insostenible y el riesgo extremo no está cubierto. Un drawdown del 32.83% frente a una relación Sharpe de 1.21 indica que la estrategia sobrevivió a una caída masiva sin generar retornos reales, lo que sugiere un sobreajuste severo a datos históricos limitados. La robustez de la estrategia es cuestionable dado que un par de operaciones no permite validar la consistencia del modelo en diferentes regímenes de mercado. Es necesario ejecutar pruebas en un periodo extendido con mayor volumen de operaciones antes de considerar esta configuración para despliegue real.

ADDITIONAL METRICS

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