



Backtest #49771 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v1051

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_v1051 muestra un ROI del 41.20% y una tasa de ganancia perfecta, pero el resultado carece de validez estadística por solo 2 operaciones. Un drawdown máximo del 32.83% indica alta volatilidad intrínseca o mala suerte en una muestra insuficiente, lo que invalida el ratio de Sharpe de 1.21. No es posible confiar en esta estrategia sin mayor volumen de datos para validar la consistencia de las ganancias. Se requiere un nuevo backtest en un rango temporal más amplio o con parámetros ajustados para reducir la exposición a eventos de cola.

ADDITIONAL METRICS

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