



Backtest #49776 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v1189

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 para EVO_GG1RSISNIP_v1189 muestra un ROI del 41.20% y una tasa de ganancia perfecta del 100%, pero con solo dos operaciones, la estadística carece de confiabilidad para cualquier conclusión robusta. El drawdown máximo del 32.83% indica una exposición al riesgo extremadamente alta que no se puede evaluar con precisión en una muestra tan pequeña. Un ratio de Sharpe de 1.21 sugiere eficiencia, pero sin más datos, el resultado podría ser simplemente una anomalía de suerte. La estrategia requiere un rediseño para generar suficientes señales en mercados laterales antes de considerar su despliegue. El siguiente paso crítico es ejecutar una prueba de estrés en al menos 500 operaciones históricas para validar la consistencia del ratio

ADDITIONAL METRICS

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