



Backtest #50212 · NVDA · EVO_GG1RSISNIP_v1444

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 NVDA con EVO_GG1RSISNIP_v1444 muestra un rendimiento negativo del 0.63% y una caída máxima del 23.49%, evidenciando una incapacidad crítica para generar alfa en esta sesión. Con solo tres operaciones, la muestra es estadísticamente insuficiente para validar la estrategia, lo que explica el ratio de Sharpe de 0.09 y una tasa de éxito del 33.3%. La baja frecuencia de operaciones sugiere que los filtros de entrada son demasiado restrictivos para las condiciones actuales del mercado de semiconductores. Se requiere ampliar el historial de datos y ajustar los umbrales de señal antes de considerar cualquier implementación real. La estrategia actual carece de robustez suficiente para ser operativa en entornos de capital institucional.

ADDITIONAL METRICS

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