



Backtest #50952 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v233

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+43.36%	1.26	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de EVO_GG1RSISNIP_v233 en SM muestra un ROI del 43.36% y una tasa de ganancia perfecta, pero la muestra de solo dos operaciones invalida cualquier conclusión estadística sobre la robustez de la estrategia. Un drawdown del 32.83% sugiere una exposición extrema a la volatilidad que el parámetro de sharpe no captura adecuadamente con tan pocas muestras. La rentabilidad del 100% se debe probablemente a un sobrevajuste de los datos o condiciones de mercado no repetibles, no a una superioridad algorítmica. Se requiere expandir el rango temporal del backtest o ajustar el umbral de entrada para filtrar falsas señales y reducir el riesgo de pérdida total. La estrategia actual no está lista para despliegue en producción sin una

ADDITIONAL METRICS

CAGR	43.36%
Sortino Ratio	0.97
Turnover	4.94x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14340.32