



Backtest #52290 · SM · EVO\_GG1RSISNIP\_v1031

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +46.62% | 1.32   | 100.0%   | -32.83%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de EVO\_GG1RSISNIP\_v1031 en SM muestra un retorno del 46.62% con una tasa de ganancia perfecta del 100% y un ratio de Sharpe de 1.32, pero estos indicadores carecen de valor estadístico al basarse únicamente en dos operaciones. La máxima caída del 32.83% revela una alta volatilidad inherente que no se mitiga con la muestra tan limitada, lo que impide confirmar la robustez de la estrategia en diferentes regímenes de mercado. Sin datos suficientes para calcular intervalos de confianza válidos, cualquier proyección de rendimiento futuro sería especulativa y potencialmente engañosamente optimista. La siguiente acción prioritaria es ejecutar una prueba de estrés con al menos 100 operaciones simuladas en diferentes periodos

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 46.62%     |
| Sortino Ratio   | 1.02       |
| Turnover        | 4.98x      |
| Total Trades    | 2          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$14666.15 |