



Backtest #52296 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v1033

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 la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1033 en SM muestra un ROI del 46.62% con una tasa de ganancia perfecta del 100%, aunque el ratio de Sharpe de 1.32 sugiere un rendimiento ajustado al riesgo moderado. Sin embargo, una muestra de solo dos operaciones es estadísticamente insuficiente para validar la robustez del modelo, lo que explica la vulnerabilidad extrema a un drawdown del 32.83%. La consistencia aparente es probablemente un resultado de sobreajuste a datos históricos limitados y no un indicador de viabilidad futura. Se debe ejecutar una validación out-of-sample con al menos 100 operaciones para determinar si la alta rentabilidad es reproducible o una anomalía. El siguiente paso crítico es ampliar el periodo de prueba para

ADDITIONAL METRICS

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