



Backtest #56678 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v386

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+47.64%	1.34	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de SM muestra un retorno del 47.64% con una tasa de ganancia perfecta, pero solo dos operaciones son insuficientes para generar confianza estadística sobre la robustez del modelo. La máxima caída del 32.83% indica que el riesgo no es constante, lo que podría llevar a un colapso de capital en una secuencia adversa real. Un ratio de Sharpe de 1.34 sugiere eficiencia, pero la falta de datos oculta patrones de sobreajuste que solo un periodo más largo podría revelar. La siguiente acción es ejecutar un backtest extendido con más ruido de mercado para validar que el rendimiento no sea producto de la suerte.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	47.64%
Sortino Ratio	1.04
Turnover	4.99x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14768.33