



Backtest #27155 · RDN · EVO_GG1RSISNIP_v14

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-7.07%	-0.40	20.0%	-15.29%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v14 sobre RDN generó un ROI de -7.07% con un Sharpe negativo de -0.40, reflejando una selección deficiente de entradas. La win rate del 20% sobre solo 5 operaciones carece de robustez estadística, haciendo los resultados estadísticamente irrelevantes. La drawdown del 15.29% superó ampliamente lo esperado para este tipo de activos, señalando fallos en la gestión de riesgo. La baja frecuencia de trades impide discernir si el problema es el activo o la lógica de señal. Es imperativo realizar walk-forward analysis con más datos para validar o descartar la estrategia antes de cualquier intento de optimización.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-7.07%
Sortino Ratio	-0.28
Turnover	9.28x
Total Trades	5
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9295.98