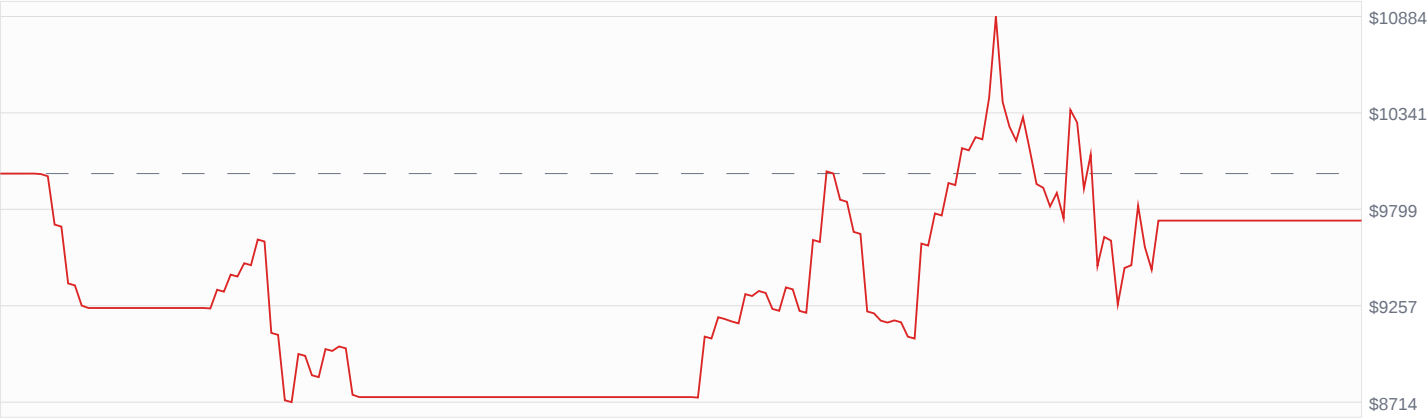




Backtest #2865 · NVDA · EVO_GG1RSISNIP_v1255

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-2.65%	-0.03	33.3%	-14.89%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia perdió capital (-2.65%) con un Sharpe negativo (-0.03) y un drawdown severo (-14.89%), indicando falta de edge estadístico. Aunque la única ganancia (+10.2%) compensó parcialmente dos pérdidas, solo tres trades son insuficientes para confiar en la tasa de aciertos del 33.3%. El equity curve muestra una caída del 14.89% antes de la recuperación parcial, lo que sugiere riesgos de cola no gestionados. Se recomienda ampliar el backtest a un universo más amplio y un periodo mínimo de 200+ trades para validar robustez. Esto es análisis educativo, no consejo de inversión.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-2.65%
Sortino Ratio	-0.02
Turnover	5.57x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9735.50