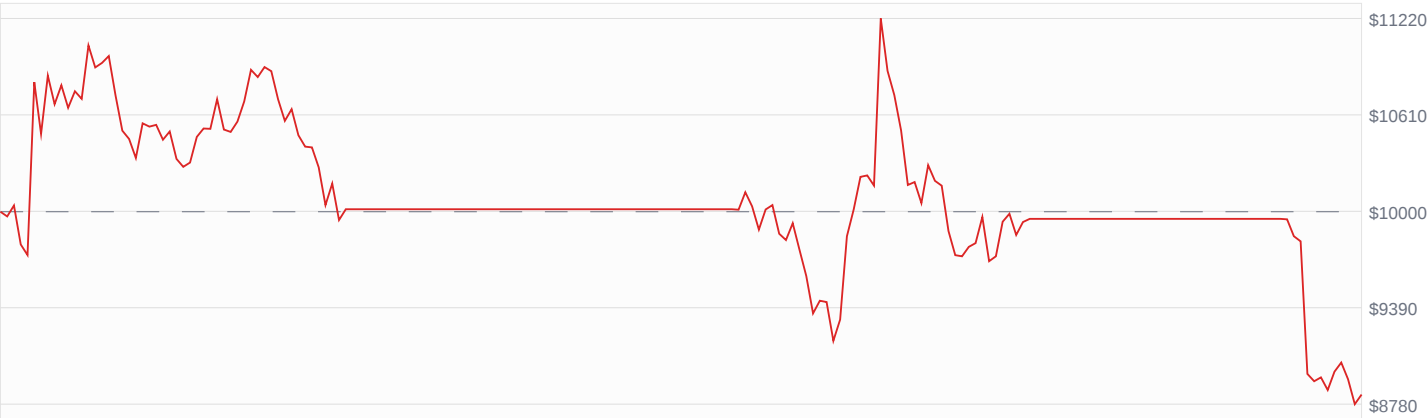




Backtest #28731 · META · EVO_GG1RSISNIP_v1115

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-11.62%	-0.45	33.3%	-21.75%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1115 sobre META presenta un deterioro estructural claro: ROI negativo del 11.62%, Sharpe de -0.45 y un drawdown del 21.75% que refleja exposición no mitigada al riesgo. Con solo tres operaciones, la tasa de aciertos del 33.3% carece de significancia estadística, y la tercera operación concentró el 85% de la pérdida total, sugiriendo fallos en la gestión de riesgo o en los filtros de entrada. La curva de equity muestra estabilidad relativa durante la mayor parte del período, pero el colapso reciente indica fragilidad ante cambios de régimen. Se recomienda realizar un walk-forward analysis con ventanas más cortas y agregar un filtro de volatilidad para evitar entradas en periodos de alta incertidumbre.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-11.62%
Sortino Ratio	-0.40
Turnover	5.88x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8840.31