



Backtest #31225 · AMD · EVO\_GG1RSISNIP\_v190

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +87.88% | 1.61   | 50.0%    | -26.05%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v190 para AMD mostró un rendimiento sólido con un ROI del 87.88% y Sharpe de 1.61, aunque el bajo número de trades (2) limita la confianza estadística. El drawdown máximo del 26.05% indica alta volatilidad, y la tasa de ganancia del 50% sugiere necesidad de mejoras en el filtro de señales. Se recomienda aumentar el volumen de backtests con al menos 50 trades para validar la robustez del modelo antes de considerar su implementación en producción.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 87.88%     |
| Sortino Ratio   | 1.44       |
| Turnover        | 4.59x      |
| Total Trades    | 2          |
| Initial Capital | \$9997.00  |
| Final Capital   | \$18788.43 |