



Backtest #31474 · META · EVO_GG1RSISNIP_v225

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

El backtest de EVO_GG1RSISNIP_v225 para META muestra resultados deficientes con una ROI negativa del -11.62% y Sharpe ratio negativo de -0.45, lo cual indica que la estrategia no generó valor durante el período analizado. Aunque el win rate del 33.3% sugiere que hay cierta coherencia en las señales, el número limitado de 3 operaciones hace que los resultados carezcan de confiabilidad estadística significativa. La alta pérdida máxima del 21.75% indica un alto riesgo de capital, lo cual es inaceptable para un entorno institucional. La falta de consistencia en las señales y la baja capacidad de generación de retorno sugieren que es necesario revisar y ajustar los parámetros de entrada de la estrategia antes de considerar una nueva ejecución con

ADDITIONAL METRICS

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