



Backtest #31477 · 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

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v225 mostró resultados negativos en backtest con META, con un ROI de -11.62% y Sharpe ratio negativo de -0.45, lo que indica falta de capacidad de generación de alpha en el periodo analizado. El win rate del 33.3% es insuficiente para considerar la estrategia viable, y el drawdown máximo del 21.75% sugiere riesgos significativos. Con tan solo 3 operaciones, la muestra carece de confiabilidad estadística, por lo que se recomienda aumentar el número de trades a al menos 30 para validar el modelo antes de considerar su implementación. El próximo paso sería reajustar los parámetros de entrada del modelo para mejorar su capacidad de detección de tendencias alcistas en activos tecnológicos como Meta.

ADDITIONAL METRICS

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