



Backtest #31792 · NVDA · EVO_GG1RSISNIP_v368

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+3.18%	0.29	50.0%	-14.89%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v368 mostró un rendimiento marginal con un ROI de +3.18%, pero con una baja confiabilidad estadística debido a solo 4 operaciones. El Sharpe ratio de 0.29 indica que el riesgo no fue compensado adecuadamente, y el drawdown máximo del 14.89% revela altos niveles de volatilidad. Se requiere una ampliación de la muestra para validar la consistencia del alfa generado. Se recomienda correr una nueva simulación con al menos 50 operaciones para evaluar mejor la robustez del modelo antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	3.18%
Sortino Ratio	0.25
Turnover	7.75x
Total Trades	4
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10320.66