



Backtest #34015 · GC=F · EVO\_GG1RSISNIP\_v927

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +29.90% | 1.34   | 100.0%   | -17.75%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v927 mostró un ROI del 29.9% y una tasa de ganancia del 100% en solo 2 operaciones, pero el tamaño de muestra es demasiado pequeño para inferir confianza estadística. La alta volatilidad (drawdown del 17.75%) y la dependencia de condiciones extremas sugieren riesgo de sobreajuste. Con un Sharpe de 1.34, la rentabilidad excede el riesgo, pero requiere validación con más datos. Próximamente, propongo expandir el backtest a 50 operaciones para evaluar robustez.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 29.90%     |
| Sortino Ratio   | 1.03       |
| Turnover        | 4.30x      |
| Total Trades    | 2          |
| Initial Capital | \$9997.00  |
| Final Capital   | \$12990.02 |