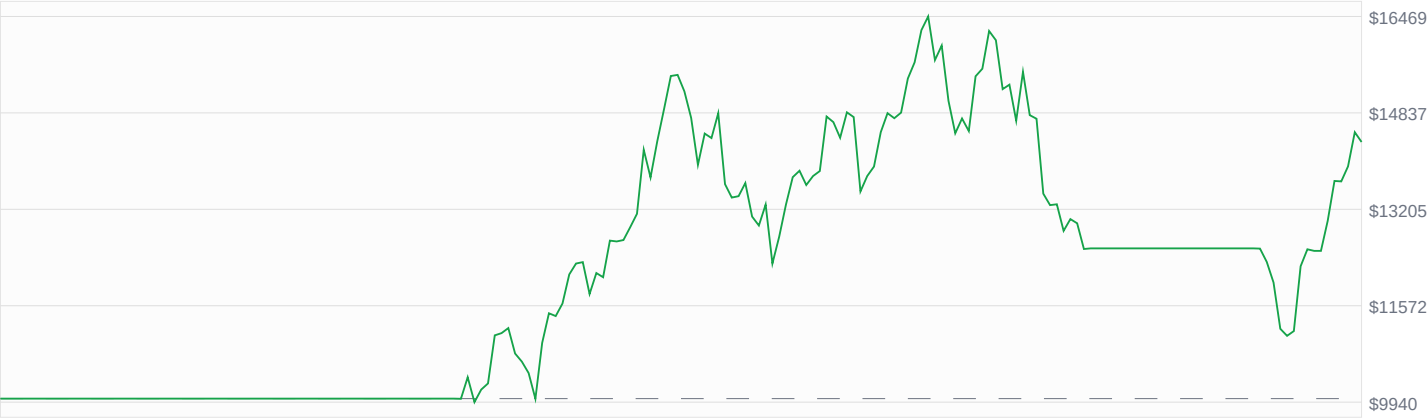




Backtest #35679 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v341

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+43.40%	1.27	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v341 sobre SM muestra un ROI del +43.40% y una tasa de win del 100% con un ratio de Sharpe de 1.27, pero solo dos operaciones validan estos resultados con una falta de robustez estadística crítica. Una caída máxima del 32.83% revela que la ausencia de pérdidas no es un indicador de solidez, sino de una muestra insuficiente para capturar la verdadera volatilidad del activo. La alta rentabilidad con tan pocas transacciones sugiere sobreajuste o una ventana de mercado muy específica que no garantiza consistencia futura. Recomendaré ampliar el conjunto de datos a al menos 100 operaciones para validar si la rentabilidad es estructural o estadística antes de cualquier despliegue real.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	43.40%
Sortino Ratio	0.94
Turnover	4.94x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14344.17