



Backtest #40922 · SM · EVO\_GG1RSISNIP\_v1540

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +41.20% | 1.21   | 100.0%   | -32.83%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de SM con EVO\_GG1RSISNIP\_v1540 muestra un rendimiento atractivo con un ROI del 41.20% y Sharpe de 1.21, aunque el win rate del 100% es sospechosamente alto para solo 2 operaciones, lo que reduce la confianza estadística. El drawdown máximo del 32.83% indica alta volatilidad y riesgo en el capital. La estrategia parece funcionar en este periodo, pero necesita más datos para confirmar su robustez. Se recomienda ampliar el backtest a más muestras de mercado para validar su consistencia.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 41.20%     |
| Sortino Ratio   | 0.94       |
| Turnover        | 4.92x      |
| Total Trades    | 2          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$14124.38 |