



Backtest #46014 · NVDA · EVO_GG1RSISNIP_v1223

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-0.63%	0.09	33.3%	-23.49%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de NVDA con EVO_GG1RSISNIP_v1223 revela un rendimiento negativo del -0.63% con una proporción de trades ganadores del 33.3%, lo cual indica una falta de consistencia en la señal. La baja rentabilidad y alta volatilidad, reflejada en un drawdown máximo del 23.49%, sugieren que el modelo no captura adecuadamente la dinámica del activo. El Sharpe ratio de 0.09 es prácticamente nulo, indicando que el riesgo no está compensado por el retorno. Con tan solo 3 trades, la muestra es demasiado pequeña para afirmar con confianza la efectividad del modelo. Se recomienda aumentar el número de trades o ajustar los parámetros de entrada para mejorar la robustez del sistema.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-0.63%
Sortino Ratio	0.08
Turnover	6.21x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9939.83