



Backtest #48272 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v1016

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_v1016 muestra un ROI del 41.20% y un drawdown máximo del 32.83%, pero la rentabilidad perfecta del 100% en solo dos operaciones carece de valor estadístico. La alta volatilidad del activo permite posiciones grandes que inflan el Sharpe de 1.21 sin garantizar consistencia en mercados reales. Se requiere expandir la muestra de datos para validar si la estrategia es robusta o simplemente una anomalía de sobreajuste en una serie temporal corta. El siguiente paso crítico es ejecutar un nuevo backtest en un rango más amplio de datos para evaluar la estabilidad de los indicadores técnicos bajo diferentes condiciones de mercado.

ADDITIONAL METRICS

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