



Backtest #48273 · 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 muestra un ROI del 41.20% y una tasa de ganancia perfecta del 100%, pero solo con dos operaciones, lo que genera una estadística estadísticamente débil y poco fiable para decisiones institucionales. La relación de Sharpe de 1.21 sugiere un rendimiento ajustado al riesgo aceptable, aunque un drawdown máximo del 32.83% revela una volatilidad extrema que no se refleja en la muestra tan pequeña. La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1016 parece ser muy sensible a condiciones de mercado específicas o al ruido de datos, ya que no ha probado su robustez ante diferentes escenarios de mercado. Es imperativo ejecutar una prueba con al menos 500 operaciones en datos de out-of-sample para validar la consistencia de las señales antes de cualquier

ADDITIONAL METRICS

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