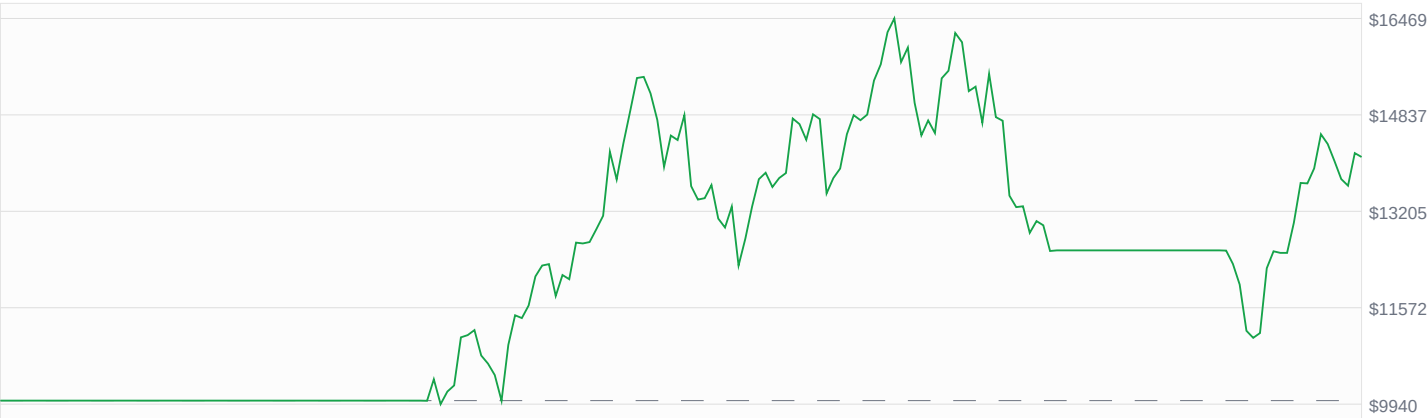




Backtest #49731 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v954

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

La estrategia SM EVO_GG1RSISNIP_v954 muestra un ROI del 41.20% y una tasa de ganancia perfecta del 100%, pero con solo dos operaciones, el resultado carece de valor estadístico y es altamente vulnerable al overfitting. El drawdown máximo del 32.83% indica una exposición al riesgo extremo que no está respaldada por un historial de resiliencia suficiente para un entorno institucional. Aunque la relación de Sharpe de 1.21 sugiere eficiencia en los rendimientos, la muestra es demasiado pequeña para descartar la suerte como factor determinante. El siguiente paso crítico es ampliar el historial de datos para validar que esta performance se sostenga en condiciones de mercado diversas y evitar la sobreoptimización. Este análisis refleja un alto potencial teórico,

ADDITIONAL METRICS

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