



Backtest #49791 · SM · EVO\_GG1RSISNIP\_v1220

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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 para EVO\_GG1RSISNIP\_v1220 muestra un ROI del 41.20% y una tasa de ganancia del 100% en solo dos operaciones, pero esta perfección es estadísticamente inconfiable por la muestra insuficiente. La alta volatilidad, evidenciada por un drawdown máximo del 32.83%, sugiere que las ganancias no cubren riesgos ocultos en mercados adversos. La razón de Sharpe de 1.21 indica una eficiencia moderada, insuficiente para estrategias institucionales robustas. Se requiere ejecutar al menos 100 operaciones en condiciones de mercado reales para validar la consistencia del modelo.

ADDITIONAL METRICS

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