



Backtest #49890 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v1290

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_v1290 muestra un ROI del +41.20% y una tasa de ganancia del 100%, pero con solo dos operaciones, la muestra es estadísticamente insostenible para inferir confiabilidad. Un drawdown máximo del 32.83% contrasta con la perfecta tasa de acierto, sugiriendo una exposición extrema a un par de movimientos de mercado sin validación histórica robusta. La razón de Sharpe de 1.21 parece artificialmente inflada por la falta de fricción y la baja frecuencia de eventos, lo que distorsiona el rendimiento real. Se requiere ampliar el periodo de prueba o reducir el tamaño de la muestra para obtener métricas significativas antes de desplegar capital.

ADDITIONAL METRICS

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