



Backtest #50182 · NVDA · EVO_GG1RSISNIP_v1420

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-0.63%	0.09	33.3%	-23.49%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTEHera local LLM

El backtest de NVDA muestra un desempeño crítico con un ROI negativo del 0.63% y una tasa de ganancia del 33.3%, lo que indica que la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1420 falló en la mayoría de sus operaciones. Con solo tres operaciones, la muestra es demasiado pequeña para inferir confiabilidad estadística, resultando en una relación de Sharpe de 0.09 que carece de poder predictivo significativo. El drawdown máximo del 23.49% revela una exposición al riesgo desproporcionada durante periodos de corrección del precio. La baja frecuencia de señales sugiere que los umbrales actuales son excesivamente restrictivos para capturar movimientos de mercado. La siguiente acción lógica es ajustar los parámetros de entrada para reducir el umbral

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-0.63%
Sortino Ratio	0.08
Turnover	6.21x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9939.83