



Backtest #50978 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v137

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+43.36%	1.26	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v137 sobre SM generó un ROI del 43.36% y una rentabilidad neta del 43.36% en un entorno de alta volatilidad, pero la rentabilidad perfecta del 100% y un drawdown máximo del 32.83% con solo dos operaciones indican una muestra estadísticamente inexistente. La alta relación de Sharpe (1.26) se ve distorsionada por la falta de eventos de pérdida, lo que impide evaluar la robustez ante condiciones adversas reales. La falta de diversidad en el historial de operaciones sugiere que el modelo podría estar sobreajustado a condiciones de mercado muy específicas. Se requiere una reoptimización del parámetro de entrada y una prueba de estrés con al menos 100 operaciones para validar la viabilidad del enfoque.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	43.36%
Sortino Ratio	0.97
Turnover	4.94x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14340.32