



Backtest #51440 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v69

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

El backtest de SM con EVO_GG1RSISNIP_v69 muestra un ROI del 43.36% y una tasa de ganancia perfecta del 100%, pero la muestra de solo dos operaciones es estadísticamente insuficiente para generar confianza institucional. Un drawdown máximo del 32.83% indica una exposición al riesgo extrema que no se mitiga con la ratio de Sharpe de 1.26 en este contexto de alta volatilidad. La estrategia captura movimientos grandes de precio pero carece de robustez ante la variación de mercado. Se requiere ampliar el historial de pruebas a al menos 100 operaciones antes de considerar su despliegue operativo real.

ADDITIONAL METRICS

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