



Backtest #51701 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v33

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 muestra un rendimiento aparente del 43.36% con una tasa de ganancia perfecta del 100%, pero la estadística carece de validez debido a la muestra de solo dos operaciones. Un máximo de caída del 32.83% indica una exposición extrema a la volatilidad sin una gestión de riesgo robusta. La alta rentabilidad en tan pocas transacciones sugiere sobreajuste (overfitting) más que una estrategia sostenible. Se requiere validar el rendimiento en al menos 100 operaciones antes de considerar cualquier implementación. La siguiente acción es ejecutar una prueba en datos fuera de muestra para evaluar la estabilidad real de la estrategia.

ADDITIONAL METRICS

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