



Backtest #56240 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v131

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+46.62%	1.32	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de EVO_GG1RSISNIP_v131 en SM muestra una rentabilidad del 46.62% y una tasa de ganancia perfecta del 100%, pero con solo dos operaciones el resultado carece de robustez estadística. La relación de Sharpe de 1.32 es respetable, aunque un drawdown máximo del 32.83% revela un riesgo extremo de capital por swing que no se ha validado con suficiente historial. No podemos confiar en la perfección del win rate al no haber sufrido pérdidas ni enfrentado un mercado lateralizado en esta muestra tan pequeña. Se requiere ejecutar una prueba de estrés con al menos 100 operaciones para confirmar si la estrategia es consistente o meramente afortunada. El siguiente paso es ajustar los filtros de entrada para evitar entradas de baja probabilidad y

ADDITIONAL METRICS

CAGR	46.62%
Sortino Ratio	1.02
Turnover	4.98x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14666.15