



Backtest #56644 · SM · EVO_GG1RSISNIP_v49

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+47.64%	1.34	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de EVO_GG1RSISNIP_v49 sobre SM muestra un rendimiento neto del 47.64% con una tasa de aciertos perfecta, pero la confianza estadística es nula al basarse en solo dos operaciones. Un drawdown máximo del 32.83% revela una exposición extrema que contradice la apariencia de seguridad de la alta win rate y el sharpe de 1.34. La estrategia funciona en condiciones ideales, pero carece de robustez ante la variabilidad del mercado real. El siguiente paso crítico es ejecutar una simulación con al menos 500 operaciones para validar la consistencia del ratio beneficio-pérdida.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	47.64%
Sortino Ratio	1.04
Turnover	4.99x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14768.33