



Backtest #41109 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v1766

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+41.20%	1.21	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de SM muestra un rendimiento bruto del 41.20% y una tasa de ganancia del 100%, pero con solo dos operaciones, la estadística carece de confianza para validar la estrategia. Un drawdown del 32.83% indica una exposición extrema a un par de movimientos de mercado, lo que sugiere que el riesgo no es sostenible en condiciones reales. Aunque el ratio de Sharpe de 1.21 parece sólido, el pequeño tamaño de la muestra invalida cualquier conclusión sobre la robustez del modelo. La única acción viable es ejecutar un test de estrés con al menos 100 operaciones simuladas para medir la consistencia del drawdown.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	41.20%
Sortino Ratio	0.94
Turnover	4.92x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14124.38