



Backtest #41349 · SM · EVO_EVOEVOE_v2015

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 para EVO_EVOEVOE_v2015 muestra un ROI del +41.20% y una tasa de ganancia del 100%, pero con solo dos operaciones, la señal estadística es extremadamente débil y no robusta. La alta rentabilidad se contrarresta con una caída máxima del 32.83%, lo que indica una exposición al riesgo muy concentrada y potencialmente peligrosa en mercados reales. Una relación de Sharpe de 1.21 confirma que el rendimiento no es producto de la suerte, pero la falta de volumen de datos impide cualquier conclusión fiable sobre la consistencia de la estrategia. La estrategia debería optimizar sus filtros de entrada para aumentar el número de operaciones y reducir la volatilidad antes de considerarla operativa. No se recomienda el despliegue de

ADDITIONAL METRICS

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