



Backtest #44101 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v1790

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 muestra un rendimiento excepcional del 41.20% con una tasa de ganancia perfecta, pero el perfil de riesgo es alarmante dada la muestra mínima de solo dos operaciones. La ausencia de drawdowns intermedios sugiere que el resultado es un sobreajuste estadístico más que una señal de consistencia operativa real. La ratio de Sharpe de 1.21 es sólida solo si se valida con un mayor volumen de datos que elimine la varianza de una sola ejecución. El siguiente paso crítico es ejecutar una simulación de estrés con al menos 1000 operaciones para confirmar la robustez de la lógica de entrada. Cualquier estrategia viable debe demostrar rentabilidad establecida en series de tiempo significativamente más largas.

ADDITIONAL METRICS

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