



Backtest #46300 · SM · EVO_EVOGG1RSIS_v432

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 reporta un ROI del 41.20% con un drawdown máximo del 32.83%, pero la tasa de win rate del 100% basada en solo dos operaciones carece de significancia estadística y no garantiza resultados futuros. Un Sharpe ratio de 1.21 sugiere un rendimiento ajustado al riesgo razonable, aunque la alta volatilidad observada en el drawdown indica una exposición extrema a movimientos de precios adversos. La estrategia EVO_EVOGG1RSIS_v432 parece estar sobre-optimizada para este pequeño conjunto de datos, lo que genera un riesgo elevado de sobreajuste. Se recomienda ejecutar una validación out-of-sample con un mínimo de 100 operaciones para confirmar la robustez antes de desplegar capital real.

ADDITIONAL METRICS

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