



Backtest #46878 · SM · EVO_EVOEVOEVOG_v468

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 una rentabilidad del 41.2% y una tasa de éxito del 100% con solo dos operaciones, lo que indica una sobreajuste estadístico extremo y falta de robustez ante el ruido del mercado. El alto drawdown del 32.8% revela que la estrategia EVO_EVOEVOEVOG_v468 sufre volatilidad severa en pocas sesiones, mientras que el Sharpe de 1.21 es engañosamente bajo dado el riesgo concentrado. Con una muestra tan pequeña, cualquier conclusión sobre la viabilidad operativa carece de valor predictivo real para un portafolio institucional. Se requiere ejecutar un backtest forward en datos no vistos o aumentar el intervalo temporal para validar si el rendimiento es sostenible y no un artefacto de datos.

ADDITIONAL METRICS

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