



Backtest #47165 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v801

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 ROI del 41.20% con una tasa de ganancia del 100% en solo dos operaciones, lo que genera un Sharpe de 1.21 pero carece de confianza estadística debido a la muestra ínfima. La ausencia de pérdidas en dos intentos sugiere una sobreajuste crítico o una suerte extrema más que una consistencia robusta, mientras que el drawdown del 32.83% revela una exposición de riesgo severa en cualquier escenario adverso. Sin datos de fricción real y volumen, los resultados actuales no permiten inferir comportamiento fuera de la simulación histórica. El siguiente paso obligatorio es expandir el periodo de prueba a al menos 500 operaciones para validar la estabilidad de la estrategia ante condiciones de mercado diversas.

ADDITIONAL METRICS

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