



Backtest #47657 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v698

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 con la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v698 muestra un rendimiento bruto del 41.20% sobre una muestra crítica de solo dos operaciones, lo que invalida cualquier confianza estadística en los resultados. Aunque el drawdown máximo del 32.83% revela un riesgo de volatilidad extremo, la tasa de acierto del 100% es matemáticamente improbable en este contexto de baja frecuencia y sugiere una sobreajuste severo a datos históricos. La relación de Sharpe de 1.21 es mediocre considerando la exposición al riesgo concentrado en pocos eventos, indicando que la estrategia carece de robustez fuera de la muestra. Para validar la viabilidad real, es imperativo expandir el conjunto de pruebas a al menos 100 operaciones con diferentes condiciones

ADDITIONAL METRICS

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