



Backtest #47710 · SM · EVO_EVOEVOE_v710

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 EVO_EVOEVOE_v710 muestra un ROI del 41.20% y una tasa de victoria del 100%, pero solo dos operaciones invalidan cualquier conclusión estadística. Una caída máxima del 32.83% indica un riesgo asimétrico extremo que no se refleja en la alta tasa de éxito. La baja muestra de datos no permite calcular un Sharpe ratio confiable ni distinguir entre suerte y habilidad. Se requiere una re-optimización con parámetros más conservadores para mitigar el drawdown. La siguiente acción debe ser ejecutar un backtest extendido en al menos 500 operaciones para validar la robustez de la señal.

ADDITIONAL METRICS

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