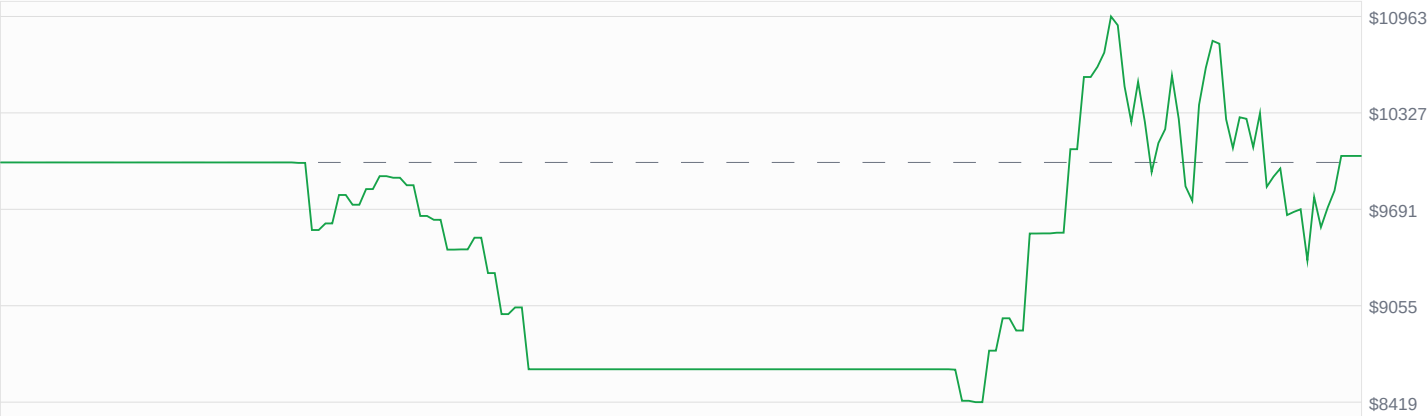




Backtest #48022 · PLMR · EVO\_EVOEVOEVOE\_v1724

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| ROI    | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +0.43% | 0.14   | 50.0%    | -14.67%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de PLMR para la estrategia EVO\_EVOEVOEVOE\_v1724 muestra una rentabilidad marginal del 0.43% con una tasa de éxito del 50%, pero el bajo Sharpe de 0.14 y una pérdida máxima del 14.67% indican un perfil de riesgo inaceptable. La muestra de solo dos operaciones es estadísticamente insuficiente para validar cualquier patrón, ya que el resultado no distingue entre ruido de mercado o una señal real. La ineficiencia del capital final frente a la volatilidad observada sugiere que los parámetros de entrada y salida deben afinarse drásticamente. Se requiere ejecutar un nuevo backtest con al menos 100 operaciones simuladas y ajustar los filtros de gestión de riesgo para evaluar la viabilidad de la estrategia.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 0.43%      |
| Sortino Ratio   | 0.10       |
| Turnover        | 3.73x      |
| Total Trades    | 2          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$10042.90 |