



Backtest #49279 · SM · EVO\_EVOEVOEVOE\_v771

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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 éxito del 100% gracias a solo dos operaciones, lo que genera un ratio de Sharpe de 1.21 pero un máximo de caída del 32.83%. La rentabilidad perfecta es estadísticamente insostenible en una muestra tan pequeña y revela un riesgo extremo de quiebra ante una sola pérdida. La alta ganancia neta se debe a la asimetría de un solo trade ganador en lugar de una estrategia robusta. La falta de diversificación y volumen de datos invalida cualquier generalización sobre la viabilidad de la estrategia a largo plazo. El siguiente paso obligatorio es ampliar el backtest con más datos históricos para validar si el modelo puede replicar resultados en condiciones de mercado cambiantes.

ADDITIONAL METRICS

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