



Backtest #50234 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v1975

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_EVOEVOEVOE_v1975 muestra una rentabilidad del 41.20% con una tasa de ganancia perfecta del 100%, pero solo en dos operaciones que invalidan cualquier confianza estadística. Un drawdown del 32.83% indica un riesgo extremo por posición, ya que una sola pérdida catastrófica eliminaría casi la mitad de las ganancias. La relación de Sharpe de 1.21 es mediocre dado el alto riesgo, sugiriendo que el modelo captura ruido en lugar de tendencias sostenibles. Es imperativo realizar un backtest en un intervalo más corto o con más datos para evaluar la robustez antes de desplegar capital real.

ADDITIONAL METRICS

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