



Backtest #53207 · SM · EVO\_EVOEVOEVOE\_v1903

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +46.62% | 1.32   | 100.0%   | -32.83%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO\_EVOEVOEVOE\_v1903 sobre SM muestra un ROI del +46.62% y una rentabilidad del 100% en solo dos operaciones, lo que indica una señal extrema de sobreajuste. Un máximo de caída del 32.83% sugiere que la ganancia se concentró en una entrada tardía y una salida temprana, con un riesgo asimétrico muy alto. La relación de Sharpe de 1.32 es irrelevante dado el tamaño muestral insuficiente para calcular una distribución de resultados confiable. Se requiere un backtest con mayor frecuencia de operaciones para validar la robustez estadística del modelo.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 46.62%     |
| Sortino Ratio   | 1.02       |
| Turnover        | 4.98x      |
| Total Trades    | 2          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$14666.15 |