



Backtest #54933 · CCNE · CCNE · EVO_WEBIDEA_v1591 (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+18.10%	1.03	100.0%	-13.17%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de CCNE muestra una rentabilidad del 18.10% y una tasa de aciertos perfecta del 100%, pero estas métricas son estadísticamente irrelevantes debido a la muestra insuficiente de solo dos operaciones. Un ratio de Sharpe de 1.03 indica un rendimiento ajustado al riesgo mediocre para un activo de renta variable, mientras que un drawdown del 13.17% revela una alta sensibilidad al riesgo en un escenario de baja frecuencia. La ausencia de datos de pérdida hace imposible validar la robustez de la lógica de salida de la estrategia EVO_WEBIDEA_v1591. Se requiere ejecutar una nueva simulación con un intervalo de tiempo más corto para generar un volumen de operaciones significativo que elimine el sesgo de sobreajuste.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	18.10%
Sortino Ratio	1.00
Turnover	4.36x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$11813.20