



Backtest #55956 · SM · EVO\_EVOEVOEVOE\_v2365

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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

El backtest de SM muestra una rentabilidad del 46.62% y una tasa de éxito del 100%, pero con solo dos operaciones, la señal estadística es insuficiente para validar la estrategia. Un drawdown del 32.83% indica una exposición extrema al riesgo que contradice la aparente consistencia de las ganancias. La alta relación de Sharpe se basa en una muestra demasiado pequeña, lo que genera resultados engañosos y falta de robustez. Se requiere ampliar el periodo de prueba o ajustar los parámetros para obtener datos con suficiente confianza estadística. El siguiente paso crítico es ejecutar una simulación con al menos 100 operaciones para confirmar la viabilidad 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 |