



Backtest #47222 · SM · EVO_EVOEVOE_v1841

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 +41.20% en SM con 100% de tasa de aciertos es estadísticamente engañoso al depender de solo dos operaciones, lo que invalida cualquier inferencia sobre la robustez de la estrategia EVO_EVOEVOE_v1841. Aunque la relación de Sharpe de 1.21 sugiere un riesgo aceptable, un drawdown del 32.83% indica volatilidad extrema que el parámetro de stop-loss actual no contiene eficazmente. La falta de diversificación en un número tan bajo de trades genera una falsa sensación de seguridad sobre la consistencia del sistema. Se requiere inmediatamente ejecutar una prueba de estrés con al menos 100 operaciones simuladas para validar si la alta rentabilidad persiste en diferentes regímenes de mercado.

ADDITIONAL METRICS

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