



Backtest #47417 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v651

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

La estrategia SM EVO_EVOEVOEVOE_v651 muestra una rentabilidad del 41.2% con una tasa de ganancia del 100% en solo dos operaciones, lo que indica una señal extrema pero no confiable estadísticamente. El alto drawdown máximo del 32.83% sugiere una exposición masiva a un riesgo concentrado sin diversificación real. Con un ratio de Sharpe de 1.21, el rendimiento ajustado al riesgo es moderado, pero la muestra insuficiente invalida cualquier conclusión sobre la robustez del modelo. Es imperativo ejecutar un test de estrés con al menos 1,000 operaciones simuladas antes de considerar la implementación en vivo. La validación del rendimiento no puede basarse en un historial tan breve y sesgado hacia la suerte.

ADDITIONAL METRICS

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