



Backtest #48022 · PLMR · EVO_EVOEVOEVOE_v1724

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+0.43%	0.14	50.0%	-14.67%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de PLMR para la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v1724 muestra una rentabilidad marginal del 0.43% con una tasa de éxito del 50%, pero el bajo Sharpe de 0.14 y una pérdida máxima del 14.67% indican un perfil de riesgo inaceptable. La muestra de solo dos operaciones es estadísticamente insuficiente para validar cualquier patrón, ya que el resultado no distingue entre ruido de mercado o una señal real. La ineficiencia del capital final frente a la volatilidad observada sugiere que los parámetros de entrada y salida deben afinarse drásticamente. Se requiere ejecutar un nuevo backtest con al menos 100 operaciones simuladas y ajustar los filtros de gestión de riesgo para evaluar la viabilidad de la estrategia.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	0.43%
Sortino Ratio	0.10
Turnover	3.73x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$10042.90