



Backtest #49037 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v1947

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 SM muestra una rentabilidad del 41.20% con una tasa de éxito del 100%, lo cual indica una señalización perfectamente sincronizada con el movimiento de mercado en este periodo. Sin embargo, la muestra de solo dos operaciones genera una carencia estadística crítica que impide validar la robustez de la estrategia frente a condiciones de mercado adversas. La máxima caída del 32.83% revela una falta de protección ante la reversión de tendencia, un riesgo que se magnifica con el escaso volumen de datos. Aunque el ratio de Sharpe de 1.21 sugiere una compensación razonable entre riesgo y retorno, el resultado es anecdótico y no representativo de un desempeño sostenible. El siguiente paso obligatorio es ejecutar una nueva simulación con al

ADDITIONAL METRICS

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