



Backtest #49279 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v771

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 un ROI del 41.20% con una tasa de éxito del 100% gracias a solo dos operaciones, lo que genera un ratio de Sharpe de 1.21 pero un máximo de caída del 32.83%. La rentabilidad perfecta es estadísticamente insostenible en una muestra tan pequeña y revela un riesgo extremo de quiebra ante una sola pérdida. La alta ganancia neta se debe a la asimetría de un solo trade ganador en lugar de una estrategia robusta. La falta de diversificación y volumen de datos invalida cualquier generalización sobre la viabilidad de la estrategia a largo plazo. El siguiente paso obligatorio es ampliar el backtest con más datos históricos para validar si el modelo puede replicar resultados en condiciones de mercado cambiantes.

ADDITIONAL METRICS

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