



Backtest #51685 · SM · Alpha Trend Follower-INVERTED

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+43.36%	1.26	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest del bot Alpha Trend Follower invertido en SM muestra un ROI del 43.36% y una tasa de ganancias perfecta del 100%, lo cual es estadísticamente engañoso al depender únicamente de dos operaciones. Una caída del capital máximo del 32.83% contrasta peligrosamente con una tasa de Sharpe modesta de 1.26, indicando que el sistema es extremadamente ineficiente y peligroso ante volatilidad real. La robustez de la estrategia es casi nula debido al tamaño de muestra insuficiente, lo que impide confiar en sus resultados actuales. Se debe ejecutar una simulación de estrés con mayor volumen de datos para validar la consistencia del algoritmo antes de cualquier despliegue operativo.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	43.36%
Sortino Ratio	0.97
Turnover	4.94x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14340.32