



Backtest #51856 · SM · EVO\_EVOEVOEVOG\_v1672

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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 de la estrategia EVO\_EVOEVOEVOG\_v1672 muestra un ROI del 43.36% y una tasa de win rate del 100%, pero estos indicadores son estadísticamente inválidos con solo dos operaciones realizadas. El drawdown máximo del 32.83% revela un riesgo extremo no mitigado, indicando que el éxito actual es probablemente producto de la suerte más que de una ventaja de mercado robusta. La relación de Sharpe de 1.26 es insuficiente para validar la consistencia del modelo sin una muestra histórica significativamente mayor. Se requiere inmediatamente ampliar el periodo de backtesting para capturar regímenes de mercado diversos y confirmar la estabilidad de los parámetros antes de cualquier despliegue en capital real.

ADDITIONAL METRICS

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