



Backtest #52643 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v2230

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+46.62%	1.32	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest del par SM con la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v2230 muestra un retorno del 46.62% y una tasa de ganancia perfecta del 100% en solo dos operaciones, pero la baja frecuencia de datos invalida cualquier conclusión estadística. Aunque el ratio de Sharpe de 1.32 indica eficiencia ajustada al riesgo en este periodo corto, la caída máxima del 32.83% expone una vulnerabilidad severa ante la variación de mercado que no se ha probado en muestras más grandes. La estrategia sobrevivió al estrés inicial sin pérdidas, pero la ausencia de datos de pérdida sugiere un sobreajuste o una suerte no sostenible en lugar de una ventaja alfa robusta. Para validar la consistencia del sistema, es imperativo ejecutar una nueva simulación con un intervalo temporal

ADDITIONAL METRICS

CAGR	46.62%
Sortino Ratio	1.02
Turnover	4.98x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14666.15