



Backtest #53791 · SM · EVO_EVOGG1RSIS_v1651

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 de SM con EVO_EVOGG1RSIS_v1651 muestra un ROI del +46.62% y un win rate perfecto, pero con solo dos operaciones, la estadística carece de robustez y el Sharpe de 1.32 es engañosamente optimista. Un drawdown máximo del 32.83% indica una exposición extrema al riesgo que no puede validarse con esta muestra tan pequeña. Confiamos poco en la consistencia de esta estrategia bajo condiciones de mercado reales debido a la falta de datos históricos suficientes. El siguiente paso crítico es ejecutar un backtest de validación con al menos 500 operaciones en diferentes regímenes de mercado.

ADDITIONAL METRICS

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