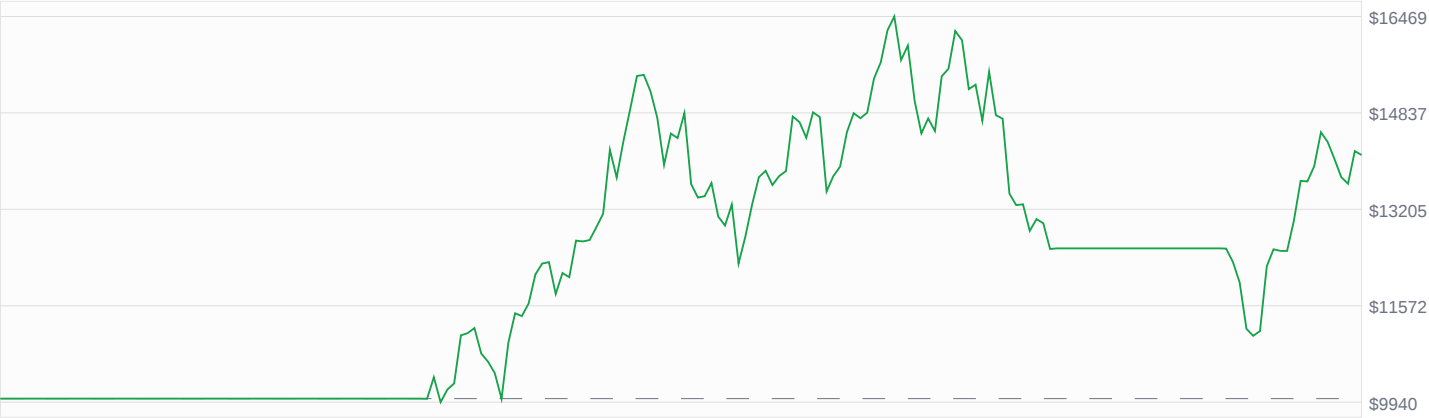




Backtest #41112 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v1772

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

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v1772 para SM muestra un ROI del 41.20% y una tasa de ganancia del 100%, pero solo con dos operaciones, lo que genera una falta crítica de confianza estadística. Aunque el ratio de Sharpe de 1.21 sugiere una relación riesgo-retorno aceptable, la caída máxima del 32.83% revela un riesgo extremo de volatilidad no mitigado en eventos de baja frecuencia. El rendimiento actual es más producto de la suerte en un conjunto de datos insuficiente que de una ventaja algorítmica robusta. Es necesario ejecutar una prueba de estresamiento en mercados de alta volatilidad para validar la consistencia real del modelo. Sin una muestra de al menos 100 operaciones, no es viable escalar este enfoque institucionalmente.

ADDITIONAL METRICS

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