



Backtest #45743 · SM · EVO_EVOGG1RSIS_v160

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

El backtest de SM con la estrategia EVO_EVOGG1RSIS_v160 muestra un ROI del 41.20% y una tasa de ganancia del 100%, pero solo en dos operaciones. Una tasa de ganancia perfecta con una muestra tan pequeña carece de valor estadístico y no garantiza consistencia en el mercado real. El drawdown máximo del 32.83% indica que la gestión de riesgo en esta configuración es insuficiente para proteger el capital frente a movimientos adversos. La relación de Sharpe de 1.21 es moderada, pero el bajo volumen de datos impide evaluar la estabilidad de los retornos ajustados al riesgo. El siguiente paso es ejecutar un nuevo backtest con al menos 100 operaciones simuladas para validar la robustez del sistema.

ADDITIONAL METRICS

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