



Backtest #47039 · SM · EVO_EVOEVOE_v807

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 EVO_EVOEVOE_v807 muestra una rentabilidad del 41.20% sobre un capital final de \$14,124.38, impulsado por una tasa de ganancias del 100% en dos operaciones, lo que sugiere una exposición extremadamente concentrada y de alto riesgo. Sin embargo, el drawdown máximo del 32.83% y una propensión a Sharpe de solo 1.21 indican volatilidad severa y una eficiencia de riesgo ajustada moderada para una estrategia institucional. Con solo dos operaciones registradas, la muestra es insuficiente para validar la robustez estadística del modelo o descartar suerte temporal. El enfoque de capitalización única expone al portafolio a un riesgo de cola desproporcionado que no se justifica con la señalización técnica actual. La siguiente

ADDITIONAL METRICS

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