



Backtest #47040 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v812

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 muestra una rentabilidad del 41.20% con una tasa de éxito perfecta, pero el pequeño conjunto de datos de solo dos operaciones limita severamente la confianza estadística de la estrategia. La relación de Sharpe de 1.21 indica un rendimiento ajustado al riesgo decente, aunque el riesgo de pérdida máxima del 32.83% revela una exposición extrema a la volatilidad en este periodo corto. Esta alta tasa de victorias podría ser un artefacto de sobreajuste en lugar de una señal de robustez operativa real para el mercado actual. Se requiere validar la lógica del cruce de medias con un periodo de prueba más largo y mayor volumen de operaciones antes de cualquier despliegue.

ADDITIONAL METRICS

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