



Backtest #47765 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v726

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 muestra una rentabilidad del 41.2% con una tasa de ganancia del 100%, lo cual indica una sobreajuste estadístico severo dado el mínimo de solo dos operaciones. La alta volatilidad observada en el máximo de caída del 32.83% sugiere que la estrategia es sensible a movimientos extremos que no han aparecido en el historial reciente. La relación de Sharpe de 1.21 confirma un retorno ajustado al riesgo, pero la falta de diversidad en las ganancias invalida cualquier conclusión sobre la robustez del modelo. Se debe ampliar la prueba de estrés con datos fuera de muestra para verificar si la tasa de victoria se mantiene bajo condiciones de mercado adversas.

ADDITIONAL METRICS

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