



Backtest #48268 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v869

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_v869 en SM muestra un rendimiento excepcional del 41.20% con una tasa de éxito del 100%, pero esta métrica carece de validez estadística al basarse únicamente en dos operaciones. Un drawdown máximo del 32.83% indica alta volatilidad interna que sugiere una exposición desproporcionada al riesgo en pocos intentos, mientras que una Sharpe de 1.21 refleja retornos ajustados por riesgo moderados. La falta de diversidad en el historial de datos impide generalizar el comportamiento ante condiciones de mercado cambiantes. El siguiente paso crítico es reversionar la lógica del filtro de entrada para probarse en al menos mil operaciones antes de cualquier despliegue real.

ADDITIONAL METRICS

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