



Backtest #49390 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v778

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_v778 para SM logró un ROI del 41.20% con una tasa de ganancia perfecta del 100%, pero solo en dos operaciones, lo que genera una confianza estadística insuficiente para validar su robustez. El ratio de Sharpe de 1.21 sugiere riesgo controlado, aunque la caída máxima del 32.83% indica que la volatilidad no fue completamente mitigada por la lógica de salida. Con una muestra tan pequeña, el resultado actual podría ser puro azar o un sobreajuste extremo a condiciones de mercado específicas. Lo que funcionó fue la captura de momentum en un par de movimientos favorables, mientras que lo que falló fue la incapacidad de generar señales consistentes para diversificar el riesgo. El siguiente paso crítico es ejecutar

ADDITIONAL METRICS

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