



Backtest #50267 · SM · EVO_EVOEVOEVOE_v1897

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 con la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v1897 muestra una rentabilidad del 41.20% y una tasa de aciertos del 100%, pero este resultado con solo dos operaciones es estadísticamente insignificante y carece de confianza práctica. La relación de Sharpe de 1.21 sugiere una compensación aceptable entre riesgo y retorno, aunque el drawdown máximo del 32.83% indica volatilidad extrema que no se refleja en el tamaño de la muestra actual. La falta de datos históricos robustos impide validar la consistencia de la estrategia frente a diferentes condiciones de mercado. Para obtener una evaluación realista, es imperativo ejecutar una prueba de estrés con datos de cinco años para medir la resiliencia ante crisis.

ADDITIONAL METRICS

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