



Backtest #53600 · SM · EVO_EVOEVOE_v1696

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+46.62%	1.32	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de SM muestra una rentabilidad del 46.62% y un ratio de Sharpe de 1.32, pero una tasa de acierto del 100% con solo dos operaciones indica sobreajuste extremo y carencia de validez estadística. Una caída del 32.83% en el máximo drawdown revela una exposición de riesgo severamente subestimada en el diseño de la estrategia EVO_EVOEVOE_v1696. Los resultados carecen de robustez porque no hay datos suficientes para confirmar si el éxito fue debido al mérito del modelo o a una suerte fortuita en un período muy corto. Para validar la viabilidad real, es imperativo ejecutar una nueva simulación con al menos 100 operaciones y añadir filtros de volatilidad para controlar el riesgo. No se recomienda operar esta configuración actual en

ADDITIONAL METRICS

CAGR	46.62%
Sortino Ratio	1.02
Turnover	4.98x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14666.15