



Backtest #55921 · SM · EVO\_EVOEVOEVOE\_v2431

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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 con la estrategia EVO\_EVOEVOEVOE\_v2431 muestra un ROI del 46.62% y una tasa de éxito del 100%, pero solo con dos operaciones, lo que invalida cualquier conclusión estadística. La máxima caída del 32.83% revela una falta severa de gestión del riesgo, mientras que la baja relación de Sharpe de 1.32 indica que el rendimiento no compensó adecuadamente la volatilidad. Un resultado perfecto con una muestra tan pequeña sugiere sobreajuste o simplemente azar, sin capacidad de generalización. Se requiere ampliar el historial con al menos 100 operaciones antes de considerar la viabilidad operativa. No se deben ejecutar posiciones basadas en estos resultados preliminares.

ADDITIONAL METRICS

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