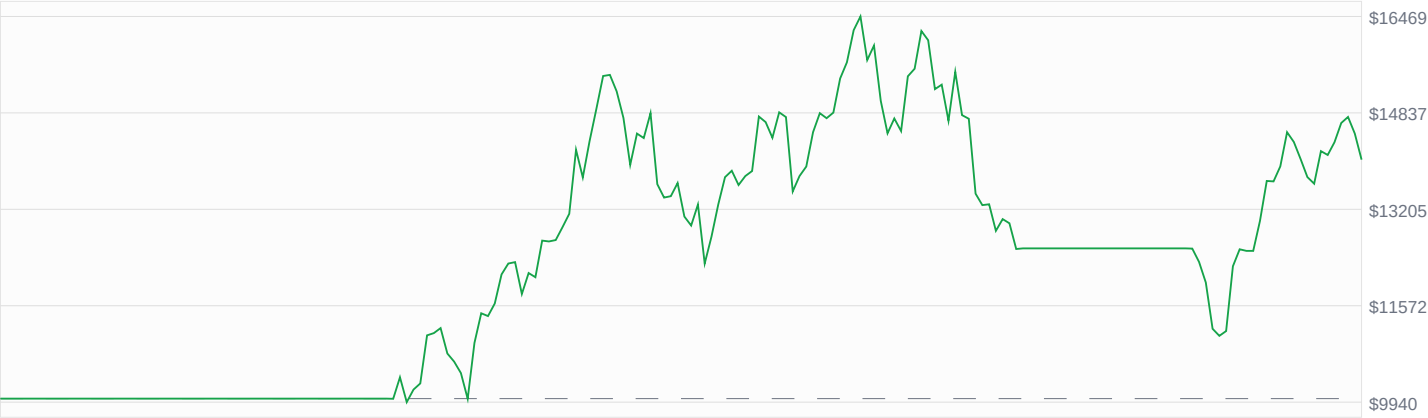




Backtest #57264 · SM · EVO_EVOWEBIDEA_v421

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+40.41%	1.19	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de SM bajo la estrategia EVO_EVOWEBIDEA_v421 reporta una rentabilidad del 40.41% y una tasa de ganancia del 100%, pero estos resultados estadísticos son altamente engañosos debido a la muestra de solo dos operaciones. Un drawdown máximo del 32.83% indica una exposición al riesgo extremo que no se refleja en el ratio de Sharpe moderado de 1.19, lo que sugiere una inestabilidad inherente al modelo. La falta de diversidad en las operaciones impide validar la robustez de la estrategia frente a condiciones de mercado adversas o cambios estructurales. Se requiere inmediatamente una re-optimización con datos fuera de muestra y el análisis de al menos 100 operaciones para establecer cualquier nivel de confianza estadística válido.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	40.41%
Sortino Ratio	0.94
Turnover	4.91x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14045.34