



Backtest #29591 · ASC · EVO_EVOEVOEVOE_v556

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+17.53%	0.81	66.7%	-17.18%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia muestra un ROI del 17.53% con una tasa de aciertos del 66.7%, pero el Sharpe de 0.81 y la caída máxima del 17.18% revelan un perfil de riesgo desajustado. Con solo tres operaciones, la muestra es estadísticamente irrelevante para validar la robustez del modelo o cualquier ventaja alfa real. El drawdown excesivo sugiere falta de filtro de volatilidad o gestión de posición inadecuada en condiciones adversas. Se requiere expandir significativamente el universo de datos para obtener significancia estadística antes de cualquier consideración de capital real.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	17.53%
Sortino Ratio	0.74
Turnover	6.22x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$11756.93