



Backtest #30002 · AMD · EVO_EVOEVOEVOE_v1884

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+87.88%	1.61	50.0%	-26.05%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v1884 muestra un ROI del 87.88% con un Sharpe de 1.61, pero con solo dos trades la significancia estadística es nula y el drawdown del 26.05% sugiere alta volatilidad no diversificada. La tasa de aciertos del 50% en una muestra tan pequeña no permite validar la robustez del modelo frente a regímenes de mercado adversos. No se puede confiar en estos resultados para toma de decisiones institucionales dado el riesgo de overfitting. Se requiere ejecutar una simulación con miles de iteraciones y datos out-of-sample para verificar la consistencia de la alpha. Sin una base de datos más sólida, cualquier inferencia sobre la rentabilidad futura sería especulativa y peligrosa.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	87.88%
Sortino Ratio	1.44
Turnover	4.59x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$18788.43