



Backtest #30535 · NVDA · EVO_EVOEVOEVOE_v790

ROI

+3.18%

Sharpe

0.29

Win Rate

50.0%

Max Drawdown

-14.89%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTEHera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v790 mostró un ROI de +3.18% en NVDA, pero con un win rate del 50% y un drawdown máximo del 14.89%, lo que sugiere alta volatilidad y poca consistencia. La muestra de solo 4 trades limita la confianza estadística, y el Sharpe de 0.29 indica rendimiento ajustado al riesgo insuficiente. La estrategia necesita optimización de parámetros y un mayor número de trades para validar su robustez. El próximo paso es aumentar el tamaño de la muestra de backtest a al menos 20 trades y ajustar los umbrales de entrada.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	3.18%
Sortino Ratio	0.25
Turnover	7.75x
Total Trades	4
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10320.66