



Backtest #3486 · ASC · EVO_GG1RSISNIP_v1358

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+18.76%	0.86	66.7%	-16.91%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El análisis se basa en los datos proporcionados por el usuario para el backtest de ASC con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1358. ROI de +18.76% y Sharpe de 0.86 son métricas sólidas, pero la muestra de solo 3 operaciones (Win Rate 66.7%) carece de solidez estadística para confiar en el resultado a largo plazo. El drawdown máximo del 16.91% es elevado para tan pocas transacciones, lo que sugiere alta variabilidad. La baja cantidad de trades impide validar la robustez del alpha generado. Se recomienda ejecutar el backtest sobre un periodo de tiempo más amplio o con datos de walk-forward para confirmar la consistencia de la estrategia antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	18.76%
Sortino Ratio	0.77
Turnover	6.05x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$11876.09