



Backtest #3556 · ASC · EVO_GG1RSISNIP_v1377

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 backtest de ASC con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1377 muestra un ROI del +18.76% y un Sharpe ratio de 0.86, lo cual sugiere rentabilidad ajustada al riesgo dentro de lo aceptable, pero el tamaño de muestra de solo 3 trades invalida cualquier conclusión estadística sólida. La drawdown máxima del -16.91% es significativa y revela exposición considerable al downside. Un win rate del 66.7% se ve sustancialmente distorsionado por el último trade que generó +\$2,893, compensando una pérdida de -\$1,324 en el segundo trade. Dada la escasez de datos, la única acción concreta es extender el backtest a un período mínimo de 50+ trades o combinarlo con walk-forward analysis para validar robustez antes de cualquier decisión.

ADDITIONAL METRICS

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