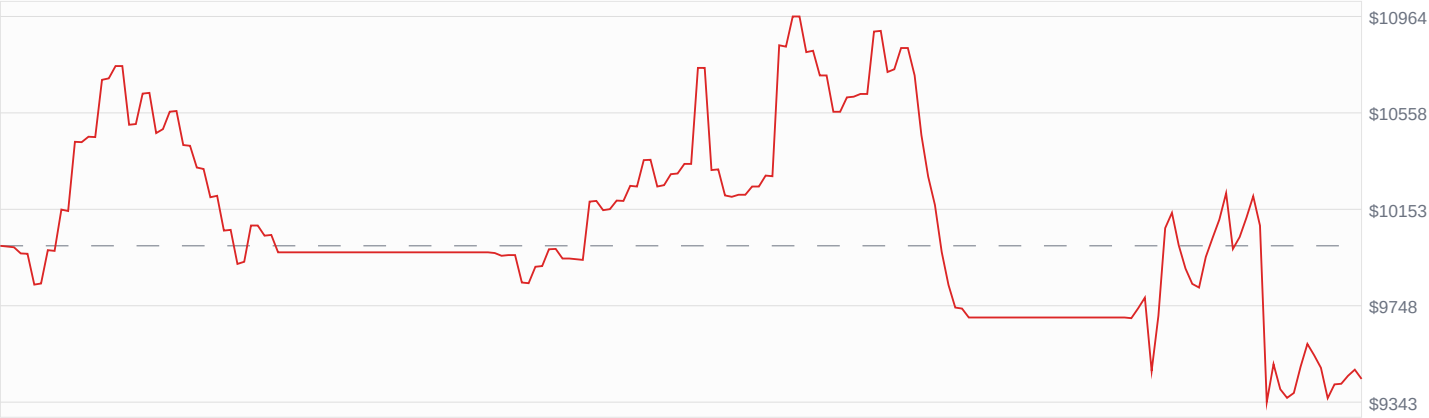




Backtest #37106 · RDN · EVO\_EVOEVOEVOE\_v2165

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| ROI    | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -5.59% | -0.31  | 0.0%     | -14.78%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de RDN muestra una ineficiencia crítica con una tasa de acierto del 0% y un drawdown máximo del 14.78%, indicando que la estrategia EVO\_EVOEVOEVOE\_v2165 genera pérdidas consistentes en este rango. Con solo tres operaciones, la muestra es demasiado pequeña para inferir confiabilidad estadística, por lo que el ratio de Sharpe negativo no es significativo sino preliminarmente alarmante. La lógica de entrada parece fallar al no filtrar condiciones de mercado adversas o de baja liquidez que disparan el riesgo. La siguiente acción obligatoria es ampliar el periodo de prueba a al menos dos años de datos para distinguir entre un error de calibración y un fallo estructural del algoritmo.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | -5.59%     |
| Sortino Ratio   | -0.25      |
| Turnover        | 5.88x      |
| Total Trades    | 3          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$9440.84  |