



Backtest #47329 · ASC · EVO_EVOEVOEVOE_v632

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+18.35%	0.82	66.7%	-17.18%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v632 mostró un ROI del 18.35% sobre solo tres operaciones en ASC, lo que indica una rentabilidad notable pero estadísticamente inestable por la falta de muestras. El drawdown del 17.18% y una relación Sharpe de 0.82 sugieren que la rentabilidad no está compensando adecuadamente el riesgo asumido en este período. Con una tasa de acierto del 66.7%, es premisa confirmar si los resultados son fruto de la suerte o de una lógica robusta antes de escalar. Se requiere ampliar el backtest a al menos 100 operaciones para validar la consistencia estadística y reducir la varianza. El siguiente paso debe ser ajustar los parámetros de entrada para mejorar el ratio riesgo-recompensa en un entorno de mayor volumen.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	18.35%
Sortino Ratio	0.76
Turnover	6.23x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$11838.67