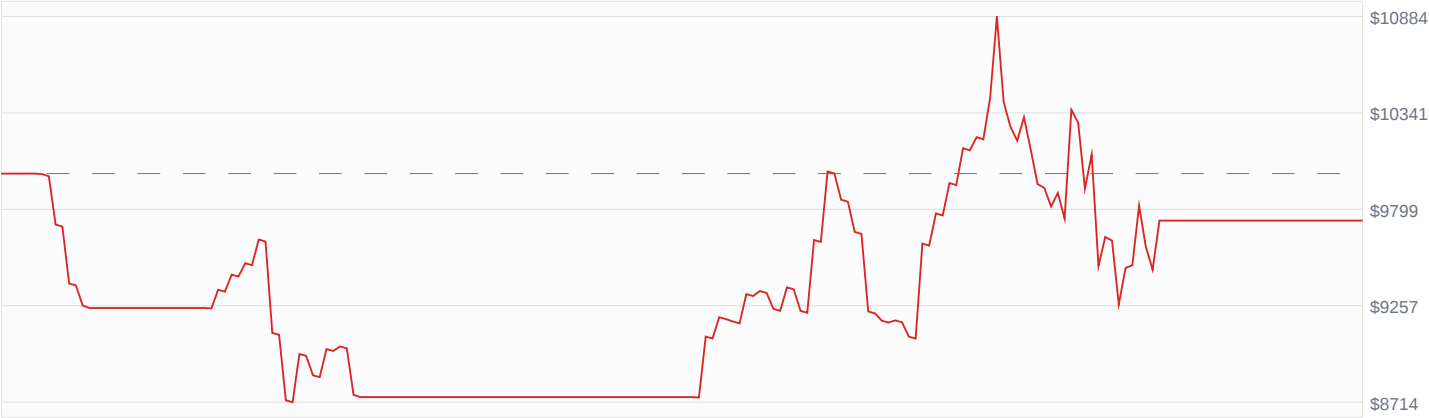




Backtest #4761 · NVDA · EVO_EVOEVOEVOE_v1756

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-2.65%	-0.03	33.3%	-14.89%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v1756 sobre NVDA presenta un ROI negativo de -2.65% con un Sharpe de -0.03, lo que indica ausencia de alpha consistente. La tasa de aciertos del 33.3% sobre solo 3 operaciones carece de significancia estadística, haciendo imposible distinguir señal de ruido. El drawdown máximo del 14.89% es desproporcionado frente al rendimiento final, revelando una gestión de riesgo deficiente. Los dos trades perdedores en febrero y marzo erosionaron rápidamente el capital antes que un único ganador en junio lo recuperara parcialmente. Se requieren al menos 50-100 trades para validar cualquier señal, por lo que se debe ampliar la ventana temporal y agregar filtros de confirmación antes de considerar una reactivación.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-2.65%
Sortino Ratio	-0.02
Turnover	5.57x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9735.50