



Backtest #49215 · NVDA · EVO_EVOGG1RSIS_v433

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-0.63%	0.09	33.3%	-23.49%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de NVDA con EVO_EVOGG1RSIS_v433 muestra una ineficiencia operativa marcada con un ROI negativo y un drawdown del 23.49%. La baja win rate del 33.3% y un Sharpe de 0.09 indican que el ruido del mercado supera a la señal en este periodo. Con solo 3 operaciones, cualquier conclusión estadística carece de poder significativo para validar la robustez del modelo. Se requiere ampliar el set de datos hacia 2026 para filtrar anomalías y reducir la varianza del cálculo del Sharpe. La revisión de los logs de ejecución es necesaria para descartar errores de lógica en la detección de señales.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-0.63%
Sortino Ratio	0.08
Turnover	6.21x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9939.83