



Backtest #49320 · ASC · EVO\_GG1RSISNIP\_v417

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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

El backtest de ASC con EVO\_GG1RSISNIP\_v417 muestra un ROI del 18.35% con una tasa de ganancia del 66.7%, pero la muestra de solo tres operaciones invalida cualquier conclusión estadística. El alto drawdown del 17.18% sugiere que la estrategia no sobrevive a una secuencia adversa típica en mercados reales. La ratio de Sharpe de 0.82 indica un rendimiento ajustado al riesgo moderado pero insuficiente para justificar el riesgo de liquidación en un entorno de bajo volumen. Es imperativo expandir el período de backtesting a al menos 100 operaciones para determinar la robustez real del modelo y filtrar sobreajustes.

ADDITIONAL METRICS

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