



Backtest #51607 · ASC · EVO_EVOEVOEVOE_v1830

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_v1830 generó un rendimiento del 18.35% sobre solo tres operaciones, lo que genera una inestabilidad estadística crítica y un nivel de confianza bajo para decisiones institucionales. Aunque la tasa de aciertos del 66.7% y la ratio de Sharpe de 0.82 sugieren una ventaja operativa real, el drawdown máximo del 17.18% indica una exposición al riesgo desproporcionada dada la escasez de datos. La falta de un historial significativo impide validar la robustez del modelo frente a diferentes regímenes de mercado o condiciones de volatilidad. Se requiere una expansión inmediata del conjunto de datos mediante pruebas en ventanas temporales más amplias o activos correlacionados para confirmar la consistencia del alpha. El siguiente

ADDITIONAL METRICS

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