



Backtest #55408 · ASC · EVO_EVOEVOEVOE_v2403

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 la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v2403 sobre ASC muestra un ROI del 18.35% con un ratio de Sharpe bajo de 0.82, lo que indica que los retornos no están ajustados adecuadamente al riesgo. La tasa de éxito del 66.7% es engañosamente alta dado un volumen de solo 3 operaciones, lo que genera una falta crítica de confianza estadística para cualquier conclusión operativa. El drawdown máximo del 17.18% revela una exposición significativa a la volatilidad que no se ha validado en periodos de mercado más largos. Es imperativo ejecutar un backtest fuera de muestra con mayor frecuencia de operaciones para determinar si el rendimiento es consistente o un resultado de sobreajuste a datos históricos.

ADDITIONAL METRICS

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