



Backtest #55580 · ASC · EVO_EVOEVOEVOE_v2148

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 muestra una rentabilidad del 18.35% con una tasa de victoria del 66.7%, pero solo 3 operaciones validan estadísticamente un perfil de riesgo moderado. La baja frecuencia de operaciones y una caída máxima del 17.18% sugieren que la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v2148 opera en regímenes de mercado muy específicos, limitando su robustez ante condiciones cambiantes. Con una relación Sharpe de 0.82, el riesgo ajustado es aceptable pero no superior, indicando que el retorno no está desproporcionadamente compensado por la volatilidad. Ante el bajo número de muestras, la señal no puede considerarse estable sin una validación en un rango temporal más amplio. La siguiente acción prioritaria es ejecutar un análisis de estrés cruzando este

ADDITIONAL METRICS

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