



Backtest #7641 · ASC · EVO_GG1RSISNIP_v1540

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+18.76%	0.86	66.7%	-16.91%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

Con tan solo 3 operaciones, el ROI del +18.76% y Sharpe de 0.86 carecen de solidez estadística; es un resultado anecdótico, no probatorio. La win rate del 66.7% se diluye en una muestra irrisoria que no permite detectar sesgos de selección ni riesgo de cola real. El max drawdown del 16.91% es alarmante para una estrategia que ejecuta tres trades; sugiere que el riesgo por operación es excesivo o que los stops no están ajustados al ATR real de ASC. No puedes extraer alpha de un n=3; el error estándar del ROI es enorme y cualquier inferencia sobre edge es pura especulación. El siguiente paso obligatorio: correr un walk-forward con al menos 50-100 trades para estabilizar el Sharpe y validar que la win rate no colapsa en out-of-sample.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	18.76%
Sortino Ratio	0.77
Turnover	6.05x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$11876.09