



Backtest #9197 · ASC · EVO\_GG1RSISNIP\_v1575

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

La muestra es demasiado pequeña (3 trades) para confiar en el ROI del +18.76% o la Sharpe de 0.86; estadísticamente es ruido. La win rate del 66.7% confirma sesgo alcista, pero el drawdown del 16.91% es excesivo para tan pocos movimientos. No hay evidencia robusta de edge real; la varianza domina. El siguiente paso es ejecutar walk-forward testing con datos OOS para validar si la estrategia sobrevive a distintos regímenes de mercado antes de cualquier consideración live.

ADDITIONAL METRICS

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