



Backtest #41368 · NVDA · EVO_EVOEVOEVOE_v2013

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-0.63%	0.09	33.3%	-23.49%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v2013 falló rotundamente en NVDA con un ROI negativo del -0.63% tras solo 3 operaciones, lo que indica una falta de robustez estadística. El Sharpe de 0.09 sugiere que el retorno no compensa el riesgo, y un win rate del 33.3% refleja una alta probabilidad de pérdidas. Con tan pocas operaciones, los resultados carecen de confiabilidad para tomar decisiones. Se recomienda aumentar el volumen de backtests con más activos y períodos para validar la estrategia antes de su implementación. El drawdown máximo del 23.49% también es preocupante para una estrategia de este tipo.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-0.63%
Sortino Ratio	0.08
Turnover	6.21x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9939.83