



Backtest #47169 · ASC · EVO_GG1RSISNIP_v90

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 muestra un rendimiento del 18.35% con una tasa de acierto del 66.7%, pero una muestra de solo 3 operaciones invalida la robustez estadística de una Sharpe de 0.82. La estrategia sobrevivió un máximo de caída del 17.18%, sugiriendo una exposición significativa al riesgo en condiciones de mercado adversas. Con tan pocos datos, el resultado actual es más suerte que consistencia algorítmica y carece de confiabilidad para gestión de capital real. Se requiere ejecutar un backtest de validación con datos de out-of-sample para confirmar si la lógica del sistema es replicable.

ADDITIONAL METRICS

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