



Backtest #47857 · AMD · EVO_EVOEVOEVOE_v751

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+87.88%	1.61	50.0%	-26.05%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AMD en la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v751 muestra un rendimiento bruto del 87.88% con una relación Sharpe de 1.61, lo cual sugiere un perfil de riesgo ajustado favorable teóricamente. Sin embargo, la alta rentabilidad se diluye drásticamente al considerar el máximo retroceso del 26.05%, indicando una exposición significativa al riesgo en un solo movimiento adverso. La muestra de dos operaciones es insuficiente para validar la robustez estadística del modelo, ya que un resultado tan positivo podría ser producto de la varianza aleatoria más que de un edge consistente. La tasa de acierto del 50% confirma que el sistema no tiene una ventaja direccional clara por sí solo. Se requiere ampliar el conjunto de datos con al menos 100

ADDITIONAL METRICS

CAGR	87.88%
Sortino Ratio	1.44
Turnover	4.59x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$18788.43