



Backtest #49694 · NVDA · EVO_WEBIDEA_v853

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

El backtest de EVO_WEBIDEA_v853 sobre NVDA muestra un rendimiento negativo del 0.63% con una relación de Sharpe marginal de 0.09, indicando falta de alpha real. Con tan solo tres operaciones, la estadística es insuficiente para validar la estrategia, lo que distorsiona métricas críticas como la tasa de éxito del 33.3% y la caída máxima del 23.49%. La muestra limitada impide determinar si el bajo rendimiento es debido a mala lógica o simplemente al azar en un periodo corto. Se requiere aumentar el volumen de operaciones o ajustar los parámetros para obtener una señal robusta estadísticamente significativa. El siguiente paso es ejecutar una nueva simulación con un filtro de volumen mínimo para filtrar operaciones ruidosas antes de

ADDITIONAL METRICS

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