



Backtest #50241 · ASC · EVO_GG1RSISNIP_v1460

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 una rentabilidad del 18.35% con una tasa de acierto del 66.7%, pero los tres operaciones son insuficientes para validar la robustez estadística de la estrategia. Un drawdown del 17.18% indica una exposición de riesgo significativa que no se mitiga con un ratio de Sharpe de 0.82, sugiriendo una baja eficiencia en la compensación de riesgo por retorno. Aunque la estrategia funciona en esta muestra reducida, la falta de datos históricos genera alta incertidumbre sobre su desempeño real fuera de este periodo específico. El siguiente paso crítico es ejecutar una ampliación del período de simulación para aumentar el volumen de operaciones y confirmar la consistencia de los resultados.

ADDITIONAL METRICS

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