



Backtest #51519 · ASC · EVO_GG1RSISNIP_v448

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

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v448 mostró una rentabilidad del 18.35% con una tasa de acierto del 66.7% en solo tres operaciones sobre ASC. Sin embargo, un drawdown máximo del 17.18% y un ratio Sharpe de 0.82 indican una exposición al riesgo elevada que no se mitiga con el volumen de datos limitado. La baja cantidad de operaciones (3) genera una alta varianza estadística que invalida cualquier conclusión sobre la robustez a largo plazo del sistema. Se requiere ampliar la prueba con más datos históricos o ajustar los parámetros de entrada para obtener una muestra estadísticamente significativa. La siguiente acción debe ser una reevaluación de los umbrales de stop-loss para controlar la volatilidad antes de escalar capital.

ADDITIONAL METRICS

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