



Backtest #52084 · ASC · EVO_EVOGG1RSIS_v442

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_EVOGG1RSIS_v442 generó un retorno del 18.35% con una tasa de ganancia del 66.7%, pero solo tres operaciones invalidan la confianza estadística de cualquier conclusión robusta. Un drawdown del 17.18% y un ratio de Sharpe de 0.82 indican que el rendimiento actual depende casi enteramente de la suerte en lugar de una ventaja de mercado consistente. Este perfil de riesgo es inaceptable para un portafolio institucional dado el riesgo de ruina implícito en una muestra tan escasa. La siguiente acción obligatoria es ejecutar una prueba de estrés extendida en al menos 1,000 iteraciones para validar la estabilidad de la señal antes de cualquier despliegue real.

ADDITIONAL METRICS

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