



Backtest #52706 · NVDA · EVO_EVOEVOEVOE_v1953

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-0.66%	0.09	33.3%	-23.49%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de NVDA con la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v1953 muestra una ineficiencia operativa severa, con un retorno negativo del -0.66% y un ratio de Sharpe de apenas 0.09. La baja tasa de éxito del 33.3% combinada con un drawdown máximo del 23.49% indica que la lógica de entrada genera pérdidas significativas en cada operación fallida. La falta de liquidez estadística es crítica, dado que solo hay 3 operaciones, lo que invalida cualquier inferencia sobre la robustez del modelo y sugiere sobreajuste a un ruido de mercado específico. Es imperativo aumentar el tamaño de muestra mediante una prueba de estrés en diferentes regímenes de volatilidad antes de considerar ajustes paramétricos.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-0.66%
Sortino Ratio	0.08
Turnover	6.21x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9937.32