



Backtest #44241 · META · EVO_EVOEVOEVOE_v2068

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-11.62%	-0.45	33.3%	-21.75%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v2068 presentó un desempeño negativo en el backtest con META, generando una ROI de -11.62% y una Sharpe ratio de -0.45, indicando que el riesgo no fue compensado por los retornos. El win rate del 33.3% sugiere una baja eficacia en la selección de señales, y el max drawdown del 21.75% refleja una exposición significativa al riesgo. Con solo 3 operaciones, la muestra es muy limitada para afirmar con confianza estadística sobre su viabilidad. El problema parece residir en una falta de filtrado efectivo en las señales de entrada. Se recomienda aumentar el volumen de trades en el backtest para validar la robustez del modelo.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-11.62%
Sortino Ratio	-0.40
Turnover	5.88x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8840.31