



Backtest #49648 · RDN · EVO_WEBIDEA_v155

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-5.59%	-0.31	0.0%	-14.78%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_WEBIDEA_v155 sobre RDN falló completamente al no registrar ninguna operación exitosa en los tres intentos, provocando una pérdida neta del 5.59%. Con un Sharpe de -0.31 y un drawdown máximo del 14.78%, el enfoque actual carece de robustez estadística y no puede considerarse viable para implementación real. La muestra de tres operaciones es insuficiente para calcular un riesgo ajustado fiable, lo que sugiere que el modelo está sobreajustado o mal calibrado para este activo. El siguiente paso crítico es reducir el umbral de entrada o ajustar el filtro de volatilidad antes de reintentar la estrategia con más datos.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-5.59%
Sortino Ratio	-0.25
Turnover	5.88x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9440.84