



Backtest #51360 · AMD · EVO\_EVOEVOEVOE\_v618

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +87.88% | 1.61   | 50.0%    | -26.05%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AMD en la estrategia EVO\_EVOEVOEVOE\_v618 muestra un ROI del 87.88% y un ratio de Sharpe de 1.61, pero solo dos operaciones son insuficientes para generar confianza estadística ante un drawdown del 26.05%. La alta rentabilidad proviene de una posición ganadora masiva en lugar de una consistencia operativa, lo que indica un riesgo extremo de sobreajuste a un solo evento de mercado. Sin un tamaño de muestra mayor, no se puede distinguir si la estrategia captura tendencias reales o simplemente suerte en un contexto específico. El siguiente paso crítico es ejecutar un backtest histórico profundo con más de 100 operaciones para validar la robustez de la señal antes de cualquier despliegue.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 87.88%     |
| Sortino Ratio   | 1.44       |
| Turnover        | 4.59x      |
| Total Trades    | 2          |
| Initial Capital | \$9997.00  |
| Final Capital   | \$18788.43 |