



Backtest #56351 · ASC · EVO_GG1RSISNIP_v288

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

El backtest de ASC muestra un ROI del 18.35% y una tasa de acierto del 66.7%, pero solo tres operaciones generan una muestra estadísticamente insuficiente para validar la robustez del sistema. Un drawdown del 17.18% indica una sensibilidad alta al riesgo que debe mitigarse antes de cualquier despliegue real de capital. La razón de Sharpe de 0.82 sugiere que el rendimiento no compensa adecuadamente la volatilidad inherente a la estrategia. Se requiere ampliar el historial con datos de al menos un año para confirmar la estabilidad de las señales y reducir el error estándar.

ADDITIONAL METRICS

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