



Backtest #46364 · LPG · EVO_EVOEVOEVOE_v1937

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+40.41%	1.10	66.7%	-21.82%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El ROI del 40.41% parece atractivo, pero el Sharpe de 1.10 y la caída máxima del 21.82% revelan un riesgo elevado para la recompensa. Con solo tres operaciones, la tasa de aciertos del 66.7% carece de significancia estadística y no valida la consistencia de la estrategia. El bajo volumen de datos impide confirmar si la curva de capital es robusta o fruto de la varianza aleatoria. El siguiente paso es ampliar la ventana de backtesting a varios años para reducir el sesgo de selección.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	40.41%
Sortino Ratio	0.90
Turnover	7.37x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14045.47