



Backtest #23778 · LPG · EVO_EVOEVOEVOE_v1811

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+24.95%	0.94	66.7%	-28.96%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El ROI del 24.95% parece atractivo, pero la muestra de tan solo tres operaciones es estadísticamente insignificante y carece de validez predictiva. Aunque la tasa de aciertos del 66.7% y el Sharpe de 0.94 sugieren eficiencia, el drawdown máximo del 28.96% revela una gestión de riesgo deficiente para un volumen tan pequeño. No existe confianza estadística alguna en estos resultados debido a la falta de diversidad en el mercado y el tamaño de muestra extremadamente bajo. Es imperativo ejecutar una simulación de Monte Carlo o extender el período de backtest para generar un dataset robusto. Solo con datos históricos ampliados podremos evaluar la solidez real de la estrategia antes de cualquier consideración operativa.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	24.95%
Sortino Ratio	0.74
Turnover	7.35x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$12498.91