



Backtest #27031 · LGND · LGND · EVO_WEBIDEA_v1591 (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+34.09%	1.22	66.7%	-18.79%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El ROI del 34.09% es atractivo pero la Sharpe de 1.22 se diluye con una muestra de solo 3 operaciones, lo que invalida la significancia estadística y sugiere suerte más que edge. La tasa de aciertos del 66.7% no compensa el drawdown del 18.79% en un horizonte tan corto, haciendo imposible evaluar la robustez del modelo. Se requiere una expansión masiva del backtest para reducir la varianza y validar si la estrategia sobrevive a condiciones de mercado adversas. Sin una muestra mayor, el riesgo de sobreajuste es crítico y la confianza en la replicabilidad es nula.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	34.09%
Sortino Ratio	1.27
Turnover	6.57x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$13412.64