



Backtest #27290 · LPG · EVO\_EVOGG1RSIS\_v156

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

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTEHera local LLM

La estrategia EVO\_EVOGG1RSIS\_v156 generó un ROI de +24.95% con un Sharpe de 0.94, pero solo 3 operaciones son estadísticamente insignificantes para confiar en la win rate del 66.7%. El drawdown máximo del 28.96% es excesivo para tan pocas transacciones, sugiriendo alta varianza y riesgo de overfitting. Sin un corpus mayor de trades, no podemos distinguir si el alpha es real o suerte. El próximo paso debe ser un walk-forward test con datos out-of-sample para validar la robustez antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

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