



Backtest #28428 · LPG · EVO_EVOEVOEVOE_v760

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+29.78%	0.91	66.7%	-21.86%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La muestra de 3 operaciones es estadísticamente insignificante y no sustenta la robustez del modelo, pese a un ROI del 29.78%. El Sharpe de 0.91 sugiere rendimientos ajustados al riesgo aceptables, pero el drawdown del 21.86% resulta excesivo para tan pocos trades, revelando alta exposición al riesgo idiosincrásico. La tasa de aciertos del 66.7% no puede validarse con significancia alguna en este horizonte. Se requiere un backtest expandido a miles de operaciones para filtrar el ruido aleatorio.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	29.78%
Sortino Ratio	0.73
Turnover	7.26x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$12981.76