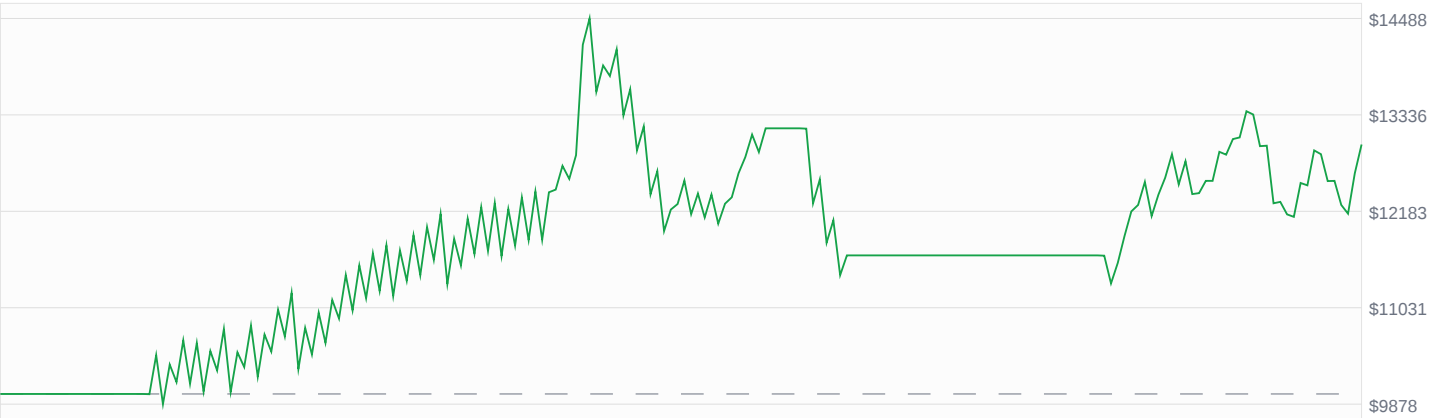




Backtest #28647 · LPG · EVO_GG1RSISNIP_v1061

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 es estadísticamente insuficiente para generalizar; tres trades no establecen confianza en la robustez del alpha. El ROI del 29.78% acompaña un Sharpe de 0.91 y un drawdown del 21.86%, indicando un perfil de riesgo asimétrico que penaliza la recompensa. La win rate del 66.7% parece sólida pero carece de respaldo en el tamaño de la muestra para validar la estabilidad de la estrategia. La correlación entre alta rentabilidad y drawdown severo sugiere sensibilidad a eventos de cola. El siguiente paso crítico es ejecutar walk-forward analysis con ventanas de 20+ trades para verificar la estabilidad de los parámetros antes de cualquier despliegue.

ADDITIONAL METRICS

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