



Backtest #3532 · LPG · EVO_GG1RSISNIP_v1371

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% es tentador, pero con solo 3 trades la confianza estadística es prácticamente nula: no hay significancia muestral, cualquier resultado puede ser puro ruido. La caída máxima del 28.96% frente a un Sharpe de 0.94 revela que el drawdown absorbió casi todo el rendimiento, lo cual es un patrón de riesgo poco saludable. La tasa de aciertos del 66.7% suena bien sobre un piso de tres operaciones, pero es insuficiente para validar la tesis de la estrategia. Sin un universo más amplio de trades, no se puede discriminar entre alpha real y varianza aleatoria. El próximo paso obligatorio es ejecutar un walk-forward test con ventanas de entrenamiento y prueba separadas para verificar robustez antes de cualquier decisión.

ADDITIONAL METRICS

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