



Backtest #3760 · LPG · EVO_GG1RSISNIP_v1411

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

La muestra de tres operaciones carece de solidez estadística; el ROI del +24.95% es anecdótico y la confianza en el Sharpe de 0.94 es nula. Aunque el win rate de 66.7% parece eficiente, el drawdown máximo del 28.96% revela una exposición al riesgo desproporcionada frente al volumen de trades. Sin diversificación temporal ni contexto de régimen de mercado, la estrategia no puede validarse como rentable. El riesgo de overfitting es extremo con este número de observaciones. Es obligatorio expandir la ventana de backtest a miles de trades para obtener señales estadísticamente significativas.

ADDITIONAL METRICS

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