



Backtest #47962 · LPG · EVO\_EVOEVOEVOG\_v1680

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +42.10% | 1.14   | 66.7%    | -21.82%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de LPG en la estrategia EVO\_EVOEVOEVOG\_v1680 muestra un retorno del 42.1% con una tasa de ganancia del 66.7%, pero la muestra de solo tres operaciones es insuficiente para validar la robustez estadística de estos resultados. La alta rentabilidad está demasiado correlacionada con un drawdown máximo del 21.82%, lo que sugiere que el rendimiento no es sostenible bajo condiciones de mercado cambiantes. Dada la alta variabilidad y el bajo volumen de datos, la confianza en la métrica de Sharpe de 1.14 es marginal y el riesgo de sobreajuste es extremo. Se requiere ampliar la ventana de retroalimentación para obtener una muestra significativa que confirme si el factor alfa es real o un artefacto de la selección de datos.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 42.10%     |
| Sortino Ratio   | 0.95       |
| Turnover        | 7.45x      |
| Total Trades    | 3          |
| Initial Capital | \$9997.00  |
| Final Capital   | \$14214.40 |