



Backtest #48824 · LPG · EVO_GG1RSISNIP_v1128

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 EVO_GG1RSISNIP_v1128 sobre LPG muestra una rentabilidad del 42.1% y una tasa de aciertos del 66.7%, pero la muestra de solo tres operaciones es estadísticamente insuficiente para validar la robustez del modelo. El riesgo de sobreajuste es alto, dado que un drawdown del 21.82% en tan pocos eventos no revela la capacidad real del sistema en regímenes de mercado adversos. Aunque el ratio de Sharpe de 1.14 sugiere una eficiencia razonable, la falta de datos impide confiar en la estabilidad de la estrategia a largo plazo. La siguiente acción prioritaria es ejecutar una prueba de estrés con al menos 200 simulaciones de Monte Carlo para determinar la varianza real del rendimiento.

ADDITIONAL METRICS

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