



Backtest #51096 · LPG · EVO_EVOGG1RSIS_v153

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+36.29%	1.04	66.7%	-21.82%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de LPG con la estrategia EVO_EVOGG1RSIS_v153 muestra un ROI del 36.29% y una tasa de aciertos del 66.7%, pero la muestra de solo tres operaciones carece de robustez estadística para validar la consistencia del modelo. A pesar de un ratio de Sharpe de 1.04, el máximo retroceso del 21.82% indica una gestión de riesgo agresiva que podría ser insostenible en condiciones de mercado cambiantes. La alta rentabilidad actual se debe probablemente a un sesgo de supervivencia en un periodo de baja volatilidad, lo que invalida cualquier conclusión sobre la viabilidad a largo plazo. Se requiere una expansión del horizonte temporal y un aumento en la frecuencia de señales para determinar si esta estrategia posee un alpha real o es simplemente

ADDITIONAL METRICS

CAGR	36.29%
Sortino Ratio	0.86
Turnover	7.16x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$13632.73