



Backtest #51421 · LPG · EVO_GG1RSISNIP_v270

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 muestra un ROI del 36.29% y una rentabilidad del 66.7%, pero solo 3 operaciones en LPG generan una confianza estadística insuficiente para validar la estrategia a largo plazo. Aunque el ratio de Sharpe de 1.04 indica un rendimiento ajustado al riesgo aceptable, un drawdown máximo del 21.82% revela una exposición significativa al riesgo que no se mitiga con la baja frecuencia de los movimientos. La alta tasa de éxito podría ser un caso de sobreajuste o suerte pura dado el pequeño tamaño de la muestra, lo que distorsiona la percepción real de la consistencia del sistema. Se requiere obligatoriamente expandir el período de prueba y aumentar la frecuencia de las operaciones para obtener una muestra representativa que elimine el ruido

ADDITIONAL METRICS

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