



Backtest #6129 · LPG · EVO\_VELOCITYSC\_v1502

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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

El backtest de LPG con la estrategia EVO\_VELOCITYSC\_v1502 muestra un ROI del +24.95% con un Sharpe de 0.94 y un win rate del 66.7%, lo que sugiere una selección de entradas efectiva. Sin embargo, el max drawdown del 28.96% es excesivamente alto para la cantidad de capital final, indicando una gestión de riesgo deficiente en momentos de reversión. Con solo 3 trades totales, la confianza estadística es prácticamente nula; cualquier métrica positiva podría ser producto de la suerte y no de una ventaja edge real. Dado el bajo número de operaciones, este resultado no es generalizable a otros regímenes de mercado ni a otros activos. El siguiente paso obligatorio es ejecutar un walk-forward analysis con ventanas de entrenamiento más amplias para

ADDITIONAL METRICS

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