



Backtest #8052 · LPG · EVO_EVOEVOEVOE_v1923

ROI

+24.95%

Sharpe

0.94

Win Rate

66.7%

Max Drawdown

-28.96%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El ROI de +24.95% parece sólido, pero con solo 3 trades el Sharpe de 0.94 carece de significancia estadística y la muestra es insuficiente para confiar en la win rate del 66.7%. El max drawdown del 28.96% es desproporcionadamente alto para el número de operaciones, lo que indica alta varianza y riesgo concentrado. No se puede extraer una ventaja estadística real de una muestra tan pequeña. El siguiente paso es ejecutar un walk-forward analysis para validar la robustez en datos out-of-sample antes de cualquier consideración de capital real.

ADDITIONAL METRICS

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