



Backtest #51092 · LPG · EVO\_WEBIDEA\_v150

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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 EVO\_WEBIDEA\_v150 muestra un rendimiento neto del 36.29% y un ratio de Sharpe de 1.04, impulsado por una tasa de aciertos del 66.7%. Sin embargo, la estrategia solo procesó tres operaciones, lo que genera una muestra estadística insuficiente para validar la robustez de los resultados ante variaciones de mercado. La caída máxima del 21.82% revela que la gestión de riesgo actual es frágil y susceptible a eventos de baja frecuencia con alto impacto. Se requiere una re-evaluación del tamaño de posición y los umbrales de entrada antes de escalar el capital.

ADDITIONAL METRICS

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