



Backtest #53200 · LPG · EVO\_EVOEVOEVOE\_v1978

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +41.35% | 1.13   | 66.7%    | -21.82%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de LPG para la estrategia EVO\_EVOEVOEVOE\_v1978 muestra un ROI del 41.35% y una tasa de acierto del 66.7%, pero con solo tres operaciones, la señal estadística es insostenible y el riesgo de sobreajuste es crítico. Una caída máxima del 21.82% indica que la gestión de capital fue ineficiente ante la volatilidad específica del activo, mientras que un ratio de Sharpe de 1.13 sugiere un rendimiento ajustado al riesgo modesto para un periodo tan corto. La falta de datos históricos suficientes impide validar la robustez de los parámetros, lo que convierte cualquier proyección futura en especulación pura. Es imperativo ejecutar una validación fuera de muestra con un mínimo de 100 operaciones para confirmar si la alfa es real o ruido de muestreo.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 41.35%     |
| Sortino Ratio   | 0.93       |
| Turnover        | 7.31x      |
| Total Trades    | 3          |
| Initial Capital | \$9997.00  |
| Final Capital   | \$14139.63 |