



Backtest #27267 · BWB · EVO_GG1RSISNIP_v144

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+3.31%	0.33	33.3%	-9.71%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v144 sobre BWB generó un ROI de +3.31% con un drawdown máximo del 9.71%, pero solo 3 operaciones en la muestra. La rentabilidad depende enteramente de un único trade ganador (+\$876.65) que compensó dos pérdidas. El Sharpe de 0.33 y el Sortino de 0.26 reflejan retornos insuficientes frente al riesgo asumido. Con n=3, no hay confianza estadística alguna en que el alpha sea real, no producto de ruido. El siguiente paso es expandir el backtest con walk-forward validation y un universo más amplio de tickers para validar robustez.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	3.31%
Sortino Ratio	0.26
Turnover	5.84x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10334.44