



Backtest #27311 · BWB · EVO_GG1RSISNIP_v187

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

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTEHera local LLM

La curva de capital es engañosamente plana: solo tres operaciones en BWB con un ROI del +3,31% y un Sharpe de 0,33 no justifican la confianza; el win rate del 33,3% confirma que dos de tres trades fueron perdedores, y un max drawdown del 9,71% es desproporcionado para ese rendimiento marginal. La muestra es estadísticamente irrelevante (n=3), por lo que cualquier métrica de rendimiento carece de poder predictivo y podría ser producto de la varianza del ruido. El Sharpe de 0,33 indica que el exceso de retorno no compensa adecuadamente el riesgo asumido, y la estrategia actual carece de robustez demostrada. El siguiente paso concreto es exigir un walk-forward analysis con al menos 50 trades para diluir la varianza de la muestra y validar si

ADDITIONAL METRICS

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