



Backtest #27355 · BWB · EVO_EVOEVOEVOE_v1978

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 muestra es extremadamente pequeña (solo 3 trades), lo que invalida cualquier conclusión estadística robusta: con un win rate del 33.3%, la estrategia depende de que cada ganancia sea significativamente mayor que las pérdidas, pero el Sharpe de 0.33 y una caída máxima del 9.71% sugieren que el ratio riesgo-beneficio no compensa suficientemente la baja frecuencia de aciertos. El ROI del +3.31% es marginal y, en un contexto institucional, no justifica la exposición al riesgo asumida, especialmente considerando la alta volatilidad inherente a BWB. La principal debilidad es la insuficiente diversificación temporal y de señales; se recomienda ejecutar un walk-forward analysis con al menos 50 trades para validar si la lógica de

ADDITIONAL METRICS

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