



Backtest #27363 · BWB · EVO_GG1RSISNIP_v222

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_v222 sobre BWB logró un ROI del +3.31%, pero con un Sharpe de 0.33 y un drawdown del -9.71%, lo que refleja una eficiencia de riesgo mediocre. Con solo 3 operaciones y un win rate del 33.3%, la muestra es estadísticamente insignificante y no permite confiar en la robustez del modelo. La relación riesgo-retorno es pobre: se asumió una caída cercana al 10% por una ganancia marginal. El siguiente paso obligatorio es ejecutar walk-forward analysis para validar la consistencia del alpha en regímenes de mercado diferentes antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

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