



Backtest #27640 · BWB · EVO_EVOEVOEVOE_v2014

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 de 3 trades es estadísticamente irrelevante; cualquier métrica aquí carece de confianza. Un ROI del 3.31% con Sharpe de 0.33 y un drawdown del 9.71% sugiere un perfil riesgo/retorno desfavorable. La win rate del 33.3% indica que la estrategia depende de ganancias excepcionales, no de consistencia. Sin un universo mayor, no se puede discriminar alpha de suerte. El siguiente paso es ejecutar walk-forward analysis con datos out-of-sample antes de considerar cualquier optimización.

ADDITIONAL METRICS

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