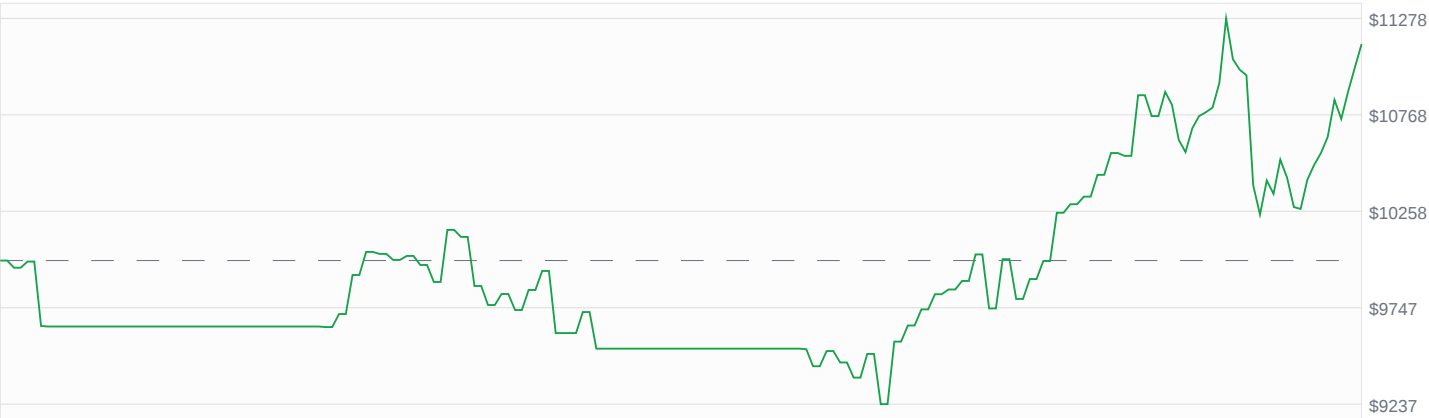




Backtest #29916 · BWB · EVO_GG1RSISNIP_v1425

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+11.39%	0.94	33.3%	-9.20%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1425 en BWB muestra un ROI del 11.39% con un Sharpe de 0.94, pero la muestra de solo 3 operaciones invalida la confianza estadística para replicabilidad institucional. Aunque el drawdown máximo se mantiene controlado en 9.20%, la baja tasa de aciertos del 33.3% sugiere alta dependencia de eventos específicos en lugar de edge consistente. El riesgo de overfitting es crítico dada la insuficiencia del tamaño de la muestra. Se requiere extender el backtest a un horizonte mínimo de 50 trades para validar la robustez del alfa. Sin datos adicionales, la estrategia debe considerarse preliminar y no apta para asignación de capital real.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	11.39%
Sortino Ratio	0.72
Turnover	5.95x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$11142.66