



Backtest #3477 · BWB · EVO\_GG1RSISNIP\_v1355

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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

El backtest de BWB con la estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v1355 muestra un ROI del +3.31% con un Sharpe de 0.33, lo que indica rendimientos ajustados al riesgo insuficientes para el nivel de volatilidad asumida. La tasa de aciertos del 33.3% es particularmente preocupante, sugiriendo que la estrategia depende de que las pocas ganancias superen ampliamente las pérdidas, un patrón de alta varianza. Con solo 3 operaciones, la muestra es estadísticamente insignificante para confiar en los resultados; el drawdown máximo del 9.71% podría ser un artefacto de la suerte en lugar de un riesgo estructural. Se requiere un backtest con un universo mucho más amplio de trades y un análisis de robustez para determinar si la señal tiene edge real.

ADDITIONAL METRICS

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