



Backtest #56868 · BWB · EVO_GG1RSISNIP_v294

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+2.15%	0.25	33.3%	-13.41%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de BWB con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v294 muestra un rendimiento marginal del 2.15% en un solo activo, lo cual es insuficiente para considerar la viabilidad del modelo en un portafolio institucional. Con solo tres operaciones registradas, los resultados carecen de robustez estadística y no permiten calcular una confianza suficiente para escalar el capital. La baja tasa de acierto del 33.3% combinada con una caída máxima del 13.41% sugiere que la estrategia es demasiado reactiva al ruido del mercado. Aumentar la frecuencia de operaciones o ajustar los umbrales de entrada es necesario para reducir la volatilidad y validar la consistencia del Sharpe.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	2.15%
Sortino Ratio	0.19
Turnover	6.13x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$10217.60