



Backtest #52193 · BWB · EVO_EVOEVOEVOE_v1684

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

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v1684 sobre BWB mostró un margen positivo del 2.15% con solo tres operaciones, lo que indica una subutilización del capital y una exposición excesiva a ruido de mercado. Un win rate del 33.3% y una relación Sharpe de 0.25 revelan una ineficiencia significativa en la generación de alpha ajustada al riesgo. El máximo drawdown del 13.41% sugiere que la gestión de capital actual no soporta la volatilidad inherente del activo durante periodos de corrección. Dada la muestra mínima, cualquier conclusión sobre la robustez estadística es prematura y carece de poder suficiente para validar la estrategia. El siguiente paso crítico es aumentar la frecuencia de operaciones mediante una reoptimización de parámetros

ADDITIONAL METRICS

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