



Backtest #41395 · BTC-USD · EVO_EVOEVOEVOE_v2011

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-11.23%	-0.69	25.0%	-24.12%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v2011 presentó un rendimiento negativo del -11.23% con una proporción de trades ganadores del 25%, lo que indica una falta de consistencia en la generación de señales. El Sharpe ratio de -0.69 sugiere que el riesgo no fue compensado adecuadamente por el retorno, y un drawdown máximo del 24.12% revela altas volatilidades sin un control efectivo de riesgo. Con tan solo 4 trades, la muestra es insuficiente para afirmar con confianza estadística la viabilidad de la estrategia. Se recomienda ajustar los parámetros de entrada para mejorar la señal de entrada y aumentar el número de trades en una nueva simulación.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-11.23%
Sortino Ratio	-0.39
Turnover	6.93x
Total Trades	4
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$8879.63