



Backtest #46625 · BTC/USD · BTC/USD · Astute AST Engine Bot (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-26.21%	-1.77	0.0%	-27.00%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia del AST Engine Bot mostró una clara falta de capacidad de generación de alpha en el periodo analizado, con una rentabilidad negativa del 26.21% y una tasa de acierto del 0.0%, lo que sugiere un fallo sistemático en la identificación de oportunidades rentables. El Sharpe negativo (-1.77) y el drawdown máximo del 27% indican que los riesgos no fueron compensados por los retornos, lo cual es preocupante desde una perspectiva de gestión de capital. Con tan solo 5 operaciones, la muestra es muy pequeña para afirmar con confianza estadística que este comportamiento es representativo. El bot no logró capturar ni una única señal ganadora, lo que apunta a una falla estructural en el diseño del filtro de entrada o en la lógica de señales. Una

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-26.21%
Sortino Ratio	-1.13
Turnover	7.99x
Total Trades	5
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$7381.71