



Backtest #53009 · BTC-USD · EVO_EVOEVOEVOE_v1969

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

El backtest de BTC-USD muestra una ineficiencia operativa severa, con un ROI negativo del 11.23% y una tasa de ganancia del 25%. La estrategia falló por una muestra estadísticamente insuficiente de solo cuatro operaciones, lo que invalida cualquier conclusión sobre la robustez del modelo. El drawdown máximo del 24.12% indica una gestión de riesgo inapropiada para condiciones de mercado volátiles. La métrica de Sharpe negativa de -0.69 confirma que la estrategia genera retornos inferiores a la alternativa libre de riesgo durante este periodo. Antes de desplegar capital real, se debe ampliar la retroalimentación temporal para validar la consistencia del algoritmo.

ADDITIONAL METRICS

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