



Backtest #53543 · BTC-USD · EVO\_EVOEVOEVOE\_v2135

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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\_v2135 falló categóricamente en BTC-USD, registrando una pérdida del 11.23% con una tasa de éxito del 25% en solo cuatro operaciones. Un drawdown máximo del 24.12% y un ratio de Sharpe negativo de -0.69 indican una exposición al riesgo desproporcionada sin capacidad de generar alfa. La validez estadística de estos resultados es nula debido a la muestra mínima, lo que impide distinguir entre mala suerte temporal y una lógica de señal defectuosa. El diseño del bot requiere una reevaluación urgente de los umbrales de entrada y una gestión de posición más conservadora antes de cualquier despliegue en vivo.

ADDITIONAL METRICS

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