



Backtest #56494 · BTC-USD · EVO_GG1RSISNIP_v342

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 éxito del 25% sobre solo cuatro operaciones. La baja cantidad de trades invalida cualquier conclusión estadística robusta, haciendo que la métrica de Sharpe de -0.69 sea altamente inestable ante variaciones del mercado. El alto drawdown del 24.12% indica una exposición excesiva a riesgos durante periodos de volatilidad sin filtros de seguridad adecuados. Antes de cualquier rediseño, es obligatorio ampliar la muestra histórica para detectar patrones reales y no ruido aleatorio. La estrategia requiere reevaluación completa de los parámetros de entrada y salida antes de su despliegue.

ADDITIONAL METRICS

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