



Backtest #57077 · BTC/USD · BTC/USD Paper 24/7 Test

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

El backtest de BTC/USD muestra un fracaso rotundo con una tasa de victoria del cero por ciento y un ROI negativo del 26.21%, impulsado por cinco operaciones que eliminaron el capital inicial. La relación de Sharpe de -1.77 y una caída máxima del 27% confirman que el riesgo de drawdown fue extremadamente alto, sugiriendo que la lógica de entrada no filtra adecuadamente la volatilidad del mercado. Con una muestra tan pequeña de solo cinco operaciones, cualquier conclusión estadística carece de potencia, pero la ausencia total de ganancias indica una falla estructural en la estrategia. El siguiente paso crítico es auditar los registros de ejecución para identificar si las entradas ocurrieron en momentos de baja liquidez o en ruptura de soporte

ADDITIONAL METRICS

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