



Backtest #2643 · BTC-USD · EVO_EVOEVOEVOE_v786

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

Análisis del Backtest: BTC-USD — EVO_EVOEVOEVOE_v786 El rendimiento es claramente no viable. ROI negativo (-11.23%), Sharpe adverso (-0.69) y una drawdown severa (-24.12%) sobre un capital inicial de ~\$10,000. El problema estructural es el sample size: solo 4 trades generan una win rate del 25% estadísticamente insignificante. No hay evidencia de edge; la variabilidad muestral es demasiado alta para tomar decisiones. La drawdown del 24% en solo 4 operaciones indica un riesgo de cola severo y posible falta de filtros de entrada. Conclusión: El bot no debe desplegarse. La muestra es insuficiente para validar cualquier hipótesis de mercado. Next Step: Ejecutar un Walk-Forward Optimization con al menos 3 ventanas de validación out-of-sample

ADDITIONAL METRICS

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