



Backtest #28556 · BTC-USD · EVO\_GG1RSISNIP\_v994

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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 candido del backtest de BTC-USD con EVO\_GG1RSISNIP\_v994. ROI negativo del -11.23%, Sharpe -0.69 y drawdown del 24.12% en solo 4 trades. La estrategia generó 3 pérdidas consecutivas antes de una ganancia aislada. El win rate del 25% con sample tan pequeño (n=4) no tiene confianza estadística — es ruido, no señal. La curva de equity muestra caídas severas sin recuperación, indicando que la lógica de entrada no filtra bien la dirección del mercado. Próximos pasos: aumentar el universo de backtest a múltiples activos y periodos, o reescribir la lógica de señal con filtros de tendencia más robustos. Esta estrategia no es viable sin reingeniería completa.

ADDITIONAL METRICS

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