



Backtest #29475 · BTC-USD · EVO_GG1RSISNIP_v895

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

EVO_GG1RSISNIP_v895 generó una pérdida del 11.23% con un drawdown severo del 24.12%, señalando fallas estructurales graves. Un Sharpe negativo de -0.69 y una tasa de acierto del 25% confirman la incapacidad del modelo para capturar alfa en BTC-USD. Sin embargo, la muestra de solo 4 operaciones carece de solidez estadística, por lo que estos resultados no son concluyentes. La alta volatilidad del drawdown sugiere que los filtros de riesgo son insuficientes para el actual régimen de mercado. Se requiere ampliar el backtest a varios meses para validar la robustez y ajustar los parámetros de salida antes de considerar su viabilidad.

ADDITIONAL METRICS

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