



Backtest #31626 · BTC-USD · EVO_GG1RSISNIP_v280

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

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v280 presentó un rendimiento negativo con una ROI de -11.23%, Sharpe negativo de -0.69 y una tasa de ganancia del 25%, lo cual sugiere que el modelo no está capturando eficazmente las oportunidades de mercado. Con solo 4 operaciones, la muestra es muy limitada para sacar conclusiones estadísticamente significativas. El alto drawdown del 24.12% indica una volatilidad excesiva en las señales generadas, lo que puede deberse a una sobreajuste o a la falta de robustez del modelo frente a condiciones del mercado cambiantes. Se recomienda realizar un nuevo backtest con un conjunto de datos más amplio y ajustar los parámetros de entrada para mejorar la estabilidad del modelo y su capacidad de generalización.

ADDITIONAL METRICS

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