



Backtest #31936 · 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 del strategy BTC/USD Paper 24/7 revela una estrategia claramente infructuosa con un ROI negativo del -26.21% y un Sharpe ratio de -1.77, indicando que las señales generadas no tuvieron capacidad de generación de alpha. La ausencia de trades ganadores (win rate 0%) y un max drawdown del 27% demuestra que la estrategia carece de eficacia en la práctica. Con solo 5 trades, la muestra es demasiado pequeña para confiar en los resultados, por lo tanto se requiere un backtest ampliado con al menos 50 trades para tener confianza estadística. El siguiente paso concreto es ajustar el filtro de entrada para incluir solo momentos de alta volatilidad, lo cual podría mejorar la calidad de las señales generadas.

ADDITIONAL METRICS

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