



Backtest #32072 · BTC-USD · EVO_EVOEVOGG1R_v463

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_EVOEVOGG1R_v463 presentó un rendimiento negativo con una pérdida neta del 11.23% sobre 4 operaciones, lo cual indica una falta de consistencia en su enfoque técnico. El ratio de Sharpe negativo de -0.69 sugiere que el riesgo no fue adecuadamente compensado por el retorno. La baja tasa de ganancia del 25% refleja una baja capacidad para identificar señales rentables. Con tan solo 4 trades, el tamaño de muestra es insuficiente para afirmar con confianza estadística la viabilidad de la estrategia. El siguiente paso sería aumentar el número de operaciones en la simulación para evaluar si hay una base sólida detrás del modelo antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

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