



Backtest #36892 · 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 de BTC/USD con un ROI negativo del 26.21% y una tasa de ganancia del 0% indica una estrategia completamente ineficaz en este período. Con solo cinco operaciones, la muestra es demasiado pequeña para establecer una confianza estadística significativa sobre el rendimiento. Una caída máxima del 27% y un ratio de Sharpe de -1.77 sugieren que la lógica de entrada generó pérdidas sistemáticas sin mecanismos de protección adecuados. Es imperativo revisar los umbrales de activación de la señal y ajustar el tamaño de posición para reducir la exposición a movimientos adversos del mercado. Solo tras un rediseño riguroso de la lógica de entrada y una validación con un conjunto de datos más amplio se podrá evaluar la viabilidad futura.

ADDITIONAL METRICS

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