



Backtest #48406 · BTC-USD · EVO\_GG1RSISNIP\_v1061

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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

El backtest de EVO\_GG1RSISNIP\_v1061 sobre BTC-USD muestra una ineficiencia operativa severa con un ROI negativo del 11.23% y una tasa de ganancia del 25%, indicando que la estrategia está generando pérdidas más frecuentes que beneficios. La relación de Sharpe de -0.69 y un máximo de caída del 24.12% en solo cuatro operaciones sugieren que la señal es demasiado ruidosa para capturar la volatilidad del mercado de criptomonedas con un perfil de riesgo aceptable. Dada la muestra estadísticamente insignificante de cuatro transacciones, los resultados actuales carecen de confiabilidad para validar la lógica subyacente de la estrategia. Se requiere una optimización agresiva de los filtros de entrada para reducir falsas señales o una

ADDITIONAL METRICS

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