



Backtest #56789 · 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 muestra una ineficiencia operativa severa con una pérdida del 26.21% y una tasa de éxito nula, lo que indica una lógica de entrada fallida. Con solo cinco operaciones, la muestra es estadísticamente insuficiente para confirmar una tendencia negativa y el ratio de Sharpe de -1.77 refleja un riesgo desproporcionado sin recompensa. La estrategia no pudo capitalizar la volatilidad del activo, resultando en un máximo de caída del 27% sobre un capital inicial de \$7,381.71. Es imperativo auditar los criterios de entrada y añadir filtros de volumen antes de desplegar el sistema en producción. No se recomienda ejecutar esta configuración actual bajo ninguna circunstancia.

ADDITIONAL METRICS

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