



Backtest #57311 · BTC-USD · EVO\_WEBIDEA\_v454

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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\_WEBIDEA\_v454 muestra una pérdida del 11.23% con una tasa de ganancias del 25%, lo que indica una ineficiencia crítica del modelo en este entorno de mercado. Con solo cuatro operaciones registradas, los resultados carecen de potencia estadística suficiente para validar la estrategia o atribuir la pérdida a condiciones de mercado específicas. El drawdown máximo del 24.12% revela un riesgo de pérdida de capital excesivo que no es sostenible para un portafolio institucional. Es imperativo reevaluar la lógica de entrada y salida para reducir la exposición en operaciones perdidas antes de replantear el algoritmo. La falta de datos históricos robustos impide cualquier recomendación de implementación en este momento.

ADDITIONAL METRICS

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