



Backtest #48704 · FIL/USD · FIL/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-2.99%	0.05	50.0%	-29.98%

EQUITY CURVE119 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de FIL/USD muestra una ineficiencia operativa crítica con una rentabilidad negativa y un drawdown del 30% derivado de solo dos operaciones. La relación Sharpe de 0.05 indica un rendimiento totalmente no ajustado al riesgo, lo que sugiere que la señal de momentum no supera el ruido del mercado en este par específico. La muestra de dos operaciones carece de poder estadístico para validar la estrategia fuera de condiciones de mercado transitorias. Se requiere ampliar el historial de pruebas o ajustar los umbrales de entrada para filtrar la baja calidad de las señales actuales.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-4.43%
Sortino Ratio	0.04
Turnover	6.01x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9700.56