



Backtest #50116 · LTC/USD · LTC/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-15.95%	-1.35	0.0%	-19.94%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de LTC/USD muestra un colapso total con una tasa de éxito del 0% y un drawdown del 19.94% sobre tan solo tres operaciones, lo que indica una incapacidad estructural del momento en este rango de precios. Un Sharpe de -1.35 confirma que la estrategia ha generado rendimiento negativo consistente en lugar de alfa positivo, sugiriendo que el filtro de TS-Momentum falló sistemáticamente durante este período. Con un tamaño de muestra tan pequeño, cualquier conclusión estadística es altamente no confiable y carece de significado práctico para decisiones de capital reales. La prioridad inmediata es auditar los logs de entrada y salida para identificar si el fallo fue causado por parámetros de stop-loss demasiado estrechos o una

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-15.95%
Sortino Ratio	-0.78
Turnover	5.59x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$8407.37