



Backtest #51842 · PEPE/USD · PEPE/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-43.79%	-2.22	33.3%	-47.27%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de PEPE/USD muestra una estrategia de momentum ineficaz con un ROI negativo del 43.79% y una tasa de ganancia del 33.3% sobre solo tres operaciones, lo que indica un sobreajuste severo a datos ruidosos y de baja frecuencia. Con una razón de Sharpe de -2.22 y una caída máxima del 47.27%, el sistema amplifica la volatilidad más que la alfa, careciendo de cualquier confianza estadística significativa dada la muestra mínima. La lógica de entrada debe revisarse para incorporar filtros de volumen o tendencias macro que excluyan movimientos de baja calidad. El siguiente paso es ampliar la ventana de backtesting para capturar ciclos de mercado completos y probar umbrales de RSI más estrictos.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-43.79%
Sortino Ratio	-1.24
Turnover	4.00x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$5622.57