



Backtest #56890 · BTC/USD · BTC/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

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 un colapso total, con una tasa de ganancia del 0% y un ROI negativo del 26.21%, lo que indica que la estrategia de momentum falló al operar contra la tendencia principal. La relación de Sharpe de -1.77 y la pérdida máxima del 27% confirman que el riesgo de liquidación fue excesivo para una muestra de solo cinco operaciones. Con tan pocos datos, cualquier conclusión estadística es altamente inconfiable y carece de robustez para validar el algoritmo en condiciones reales. La causa probable radica en una entrada demasiado agresiva en un entorno de baja volatilidad o una salida prematura que no permitió recuperar capital. El paso inmediato es ajustar los filtros de entrada para evitar posiciones de pérdida

ADDITIONAL METRICS

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