



Backtest #46863 · ETH/USD · ETH/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-32.47%	-1.45	33.3%	-37.64%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de la estrategia ETH/USD muestra un desempeño ineficaz con una pérdida de -32.47% y una tasa de aciertos del 33.3%, lo que indica una incapacidad para generar alfa en el entorno actual. La relación de Sharpe de -1.45 y un drawdown máximo del 37.64% sugieren que los movimientos de tendencia capturados fueron contraproducentes, probablemente debido a una exposición excesiva a volatilidad sin suficiente protección. Con solo tres operaciones ejecutadas, la muestra es estadísticamente insostenible para validar la lógica del sistema, lo que invalida cualquier conclusión sobre la robustez del algoritmo. Se requiere una reconfiguración inmediata de los parámetros de entrada y salida, o una ampliación del periodo de

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-32.47%
Sortino Ratio	-0.91
Turnover	4.37x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$6755.15