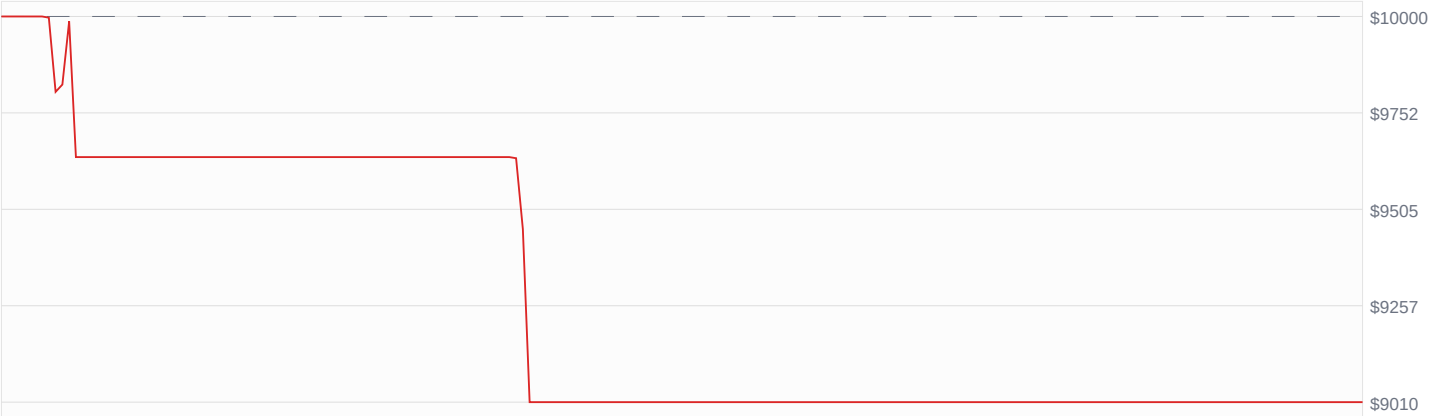




Backtest #47728 · TRUMP/USD · TRUMP/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-9.90%	-1.72	0.0%	-9.90%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de TRUMP/USD muestra un fracaso total con una tasa de acierto del 0% y una pérdida del 10% en solo dos operaciones, lo que indica una falta de robustez estadística. Un ratio de Sharpe negativo de -1.72 confirma que la estrategia ha destruido capital más rápido de lo que ha generado ganancias. Con una muestra tan pequeña, es imposible distinguir entre ruido del mercado y una señal válida, por lo que los resultados carecen de cualquier valor predictivo confiable. La estrategia de momentum 24/7 parece ineficaz para este par específico, sugiriendo una mala alineación con la volatilidad actual. El siguiente paso crítico es detener la exposición inmediata y realizar una revisión manual de los umbrales de entrada para filtrar los falsos

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-9.90%
Sortino Ratio	-0.31
Turnover	3.83x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9009.95