



Backtest #48693 · 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 ETH/USD muestra una ineficiencia operativa crítica, con una pérdida del 32.47% y un ratio de Sharpe negativo de 1.45. La estrategia de momentum de alta frecuencia falló al generar solo tres operaciones con una tasa de éxito del 33.3%, lo que indica una incapacidad para filtrar ruido de mercado en el periodo probado. Un drawdown máximo del 37.64% sugiere una gestión de riesgo inadecuada para este par, donde la exposición fue excesiva sin validación estadística suficiente. Dado el bajo número de operaciones, los resultados carecen de significancia estadística y no permiten inferir la robustez del modelo ante diferentes condiciones de mercado. El siguiente paso lógico es ajustar los umbrales de entrada para reducir

ADDITIONAL METRICS

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