



Backtest #49482 · 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 con la estrategia de momentum TS-24/7 muestra una performance catastrófica con un ROI negativo del 26.21% y una tasa de ganancia del 0%, indicando una incapacidad total del modelo para capturar movimientos alcistas en la muestra probada. La ausencia de operaciones ganadoras entre solo 5 transacciones revela una baja robustez estadística que imposibilita generalizar la estrategia a otros periodos de mercado sin un riesgo de sobreajuste extremo. El drawdown máximo del 27% confirma una exposición excesiva a la volatilidad sin mecanismos de protección efectivos, lo que invalida el uso actual del parámetro de tiempo 24/7 para este activo. Como paso inmediato, es imperativo reducir la frecuencia de

ADDITIONAL METRICS

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