



Backtest #50489 · 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 estrategia de momentum ineficaz, con pérdidas del 32.47% y una tasa de victoria de solo 33.3%, lo que indica señales de entrada mal posicionadas en una tendencia bajista. Un drawdown del 37.64% y un ratio de Sharpe negativo de -1.45 revelan un perfil de riesgo excesivo y alta volatilidad no mitigada por la gestión de capital. La muestra de solo tres operaciones es estadísticamente insuficiente para validar la robustez del modelo, haciendo que estos resultados sean altamente sensibles a eventos de ruido específicos. Dado el bajo volumen histórico, es imperativo ajustar los filtros de entrada para reducir la frecuencia de señales o probar parámetros en intervalos horarios más estables antes de cualquier despliegue

ADDITIONAL METRICS

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