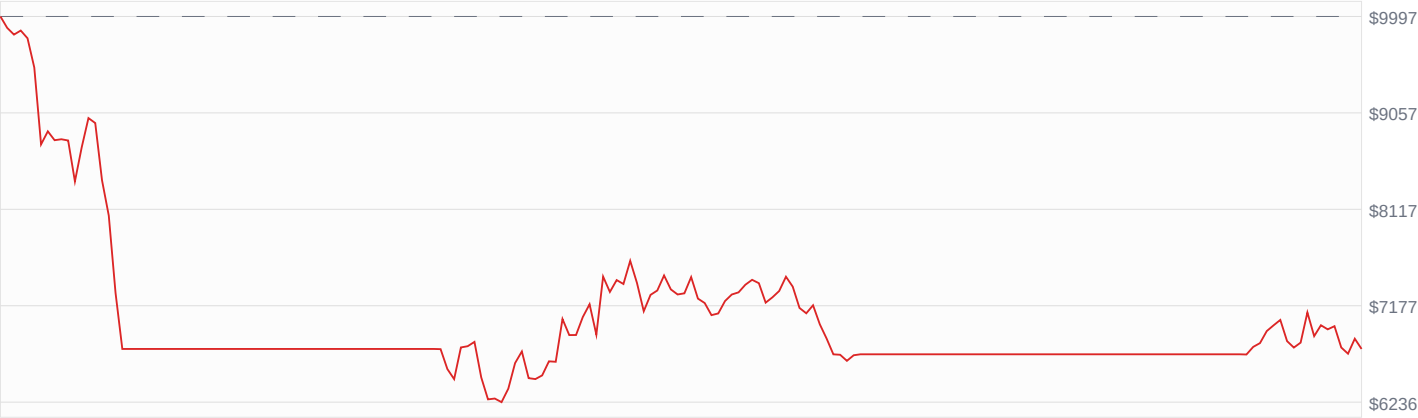




Backtest #50646 · ETH/USD · ETH/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

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 señalización ineficiente con solo tres operaciones, lo que invalida cualquier conclusión estadística robusta. La estrategia de momentum capturó una tendencia bajista extrema sin filtrar la volatilidad, provocando un drawdown del 37.64% y un ROI negativo significativo. Con una tasa de éxito del 33.3% y un ratio de Sharpe de -1.45, el modelo carece de confiabilidad para un entorno de 24/7. La próxima iteración debe incorporar umbrales de RSI más conservadores y un filtro de volumen para evitar entradas en zonas de baja liquidez.

ADDITIONAL METRICS

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