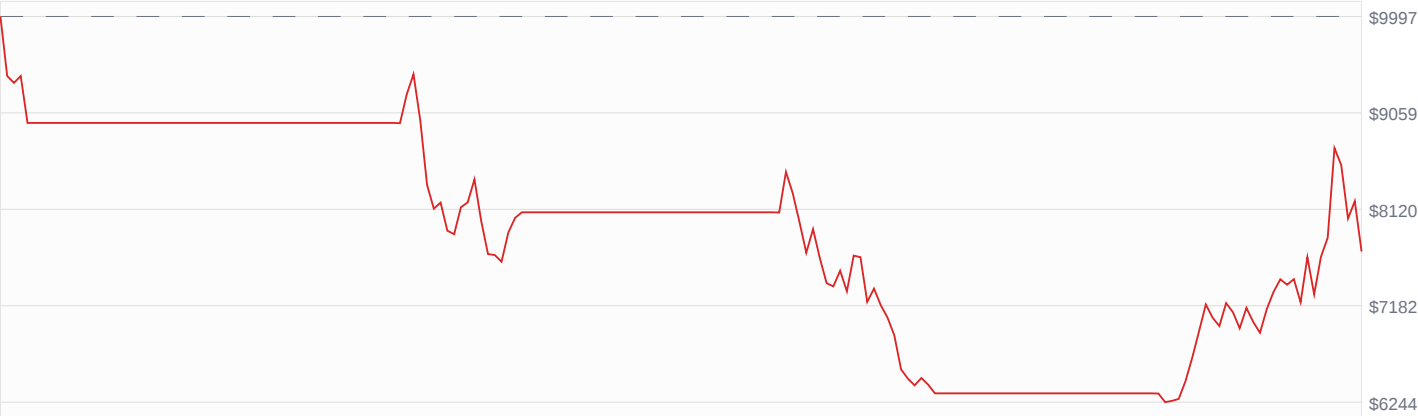




Backtest #51901 · UNI/USD · UNI/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-22.93%	-0.83	25.0%	-37.56%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de UNI/USD revela una estrategia de momentum fallida con un ROI negativo del 22.93% y una tasa de éxito del 25%, lo que indica una exposición excesiva a movimientos de precio sin suficientes filtros de tendencia. Solo cuatro operaciones en la muestra generan una estadística insostenible que carece de poder significativo para validar la lógica del sistema ante el ruido del mercado. La relación de Sharpe de -0.83 y un drawdown máximo del 37.6% confirman que el enfoque de trading 24/7 genera pérdidas mayores a las ganancias en este par específico. Es imperativo aumentar la frecuencia de operaciones mediante un historial más largo o ajustar los umbrales de entrada para filtrar mercados laterales. La siguiente acción consiste en ejecutar

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-22.93%
Sortino Ratio	-0.54
Turnover	6.45x
Total Trades	4
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$7709.69