



Backtest #56602 · 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 mostró una ineficacia total, registrando una tasa de ganancia del 0% y una pérdida de capital del 26,21% con solo cinco operaciones. La estrategia de momentum en este periodo capturó movimientos de tendencia sin éxito alguno, resultando en una relación de Sharpe negativa de -1,77 y un drawdown máximo del 27%. Dada la muestra limitada de cinco trades, cualquier conclusión estadística sobre la viabilidad del modelo carece de validez confiable. El análisis sugiere que los parámetros de entrada o el horizonte temporal de 24/7 no se adaptaron a la volatilidad actual del activo. Se requiere una re-optimización de los umbrales de señal y un re-backtesting con mayor volumen de datos antes de considerar su despliegue.

ADDITIONAL METRICS

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