



Backtest #30546 · PEPE/USD · PEPE/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-43.79%	-2.22	33.3%	-47.27%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de PEPE/USD revela un rendimiento negativo con ROI de -43.79%, Sharpe ratio negativo de -2.22 y una tasa de ganancia del 33.3%, lo que indica una estrategia infructuosa. Con solo 3 operaciones, la muestra es demasiado pequeña para afirmar con confianza estadística. El momentum no capturó tendencias claras ni gestionó eficazmente el riesgo. El próximo paso debe ser aumentar el número de trades a al menos 50 para obtener una estimación más robusta de la estrategia.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-43.79%
Sortino Ratio	-1.24
Turnover	4.00x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$5622.57