



Backtest #30550 · 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

La estrategia de momentum no mostró capacidad de generación de alpha, con una ROI negativa del -26.21% y un Sharpe ratio de -1.77, indicando que el riesgo superó los retornos. A pesar de la baja tasa de ganancia (0%), la muestra de solo 5 operaciones limita la confianza estadística. Un próximo paso sería aumentar el tamaño de la muestra mediante backtesting extendido o ajustar parámetros de entrada para mejorar la detección de tendencias. Los resultados sugieren que se requiere una mejor selección de señales o ajustes en el modelo de entrada para mejorar el rendimiento.

ADDITIONAL METRICS

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