



Backtest #31848 · 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 con estrategia TS-Momentum muestra un rendimiento negativo del -26.21% con Sharpe de -1.77, win rate del 0.0% y drawdown máximo del 27.00% en solo 5 operaciones, lo cual sugiere baja confiabilidad estadística. La falta de trades ganadores indica que el filtro de entrada no está capturando oportunidades, y el rendimiento negativo sugiere un mal ajuste del modelo. Se recomienda validar el modelo con al menos 20 operaciones para obtener un intervalo de confianza más robusto. La estrategia requiere revisión del umbral de entrada y posiblemente ajuste del filtro de riesgo.

ADDITIONAL METRICS

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