



Backtest #32870 · 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 muestra una pérdida significativa (ROI: -22.93%) con un ratio Sharpe negativo (-0.83), indicando gestión de riesgo deficiente. Solo 25% de ganancias y un drawdown máximo del 37.56% sugieren falta de robustez en la estrategia. La muestra de 4 operaciones es estadísticamente insuficiente para validar resultados. Se requiere un mayor volumen de datos para evaluar la efectividad del enfoque de momentum. Next step: expandir el histórico de prueba para validar la consistencia.

ADDITIONAL METRICS

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