



Backtest #33261 · ETH/USD · ETH/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-32.47%	-1.45	33.3%	-37.64%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de ETH/USD muestra una ineficacia operativa severa, con una pérdida del 32.47% y un drawdown máximo del 37.64% derivado de una estrategia de momento que falló en los tres intentos. La relación de Sharpe de -1.45 indica que la estrategia ha generado más volatilidad adversa que rentabilidad ajustada al riesgo, lo cual es insostenible para un entorno institucional. La confianza estadística es nula debido a la muestra de solo tres operaciones, lo que impide distinguir si el desempeño es fruto de mala suerte o de una lógica de señal intrínsecamente defectuosa. Dado el alto riesgo de ruina en escenarios de baja liquidez, el próximo paso crítico es reevaluar el umbral de entrada del momentum y ajustar el tamaño de posición para mitigar la

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-32.47%
Sortino Ratio	-0.91
Turnover	4.37x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$6755.15