



Backtest #33262 · 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 revela una estrategia de momentum sobre-capitalizada en un periodo demasiado corto, con solo tres operaciones que generan una pérdida del 32.47% y un drawdown del 37.64%, lo que indica una falta de robustez estadística ante la alta volatilidad de ETH/USD. La tasa de ganancia del 33.3% y el ratio de Sharpe negativo de -1.45 confirman que la señal de tendencia actual no sobrevive a la fricción del mercado, sugiriendo que el filtro de 24/7 es demasiado ruidoso para este activo. Dada la muestra insuficiente, cualquier conclusión sobre la viabilidad del sistema carece de confianza estadística y podría ser simplemente ruido aleatorio. Como siguiente paso concreto, se requiere ampliar el marco temporal de validación a al menos seis

ADDITIONAL METRICS

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