



Backtest #35750 · BTC/USD · TS-Momentum Crypto (24/7)

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 TS-Momentum en BTC/USD mostró una incapacidad total para capturar ganancias, evidenciado por una tasa de éxito del 0% y una caída máxima del 27%. La estrategia de momento 24/7 falló al no filtrar la volatilidad extrema, resultando en cinco operaciones sin una sola ganancia neta. Con una muestra tan pequeña de solo cinco operaciones, cualquier conclusión estadística carece de confianza suficiente para justificar una implementación real. La relación de Sharpe negativa de -1.77 confirma que el rendimiento fue peor que mantener el capital en efectivo durante el periodo analizado. El siguiente paso inmediato es reducir drásticamente la frecuencia de operaciones para filtrar solo los movimientos de tendencia más robustos y validar

ADDITIONAL METRICS

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