



Backtest #36854 · 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 Crypto muestra un rendimiento negativo del 26.21% y una tasa de éxito del 0.0% en solo 5 operaciones, lo que indica una estrategia ineficaz en este periodo. La relación de Sharpe de -1.77 refleja pérdidas consistentes con un máximo de caída del 27.00%, sugiriendo que las reglas de entrada no filtraron correctamente el ruido de mercado. Con una muestra estadísticamente insuficiente de cinco operaciones, los resultados carecen de validez para confirmar un patrón de mercado. Se requiere ajustar los umbrales de momento y reducir la frecuencia de señales para alinear la estrategia con las condiciones actuales de volatilidad de Bitcoin.

ADDITIONAL METRICS

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