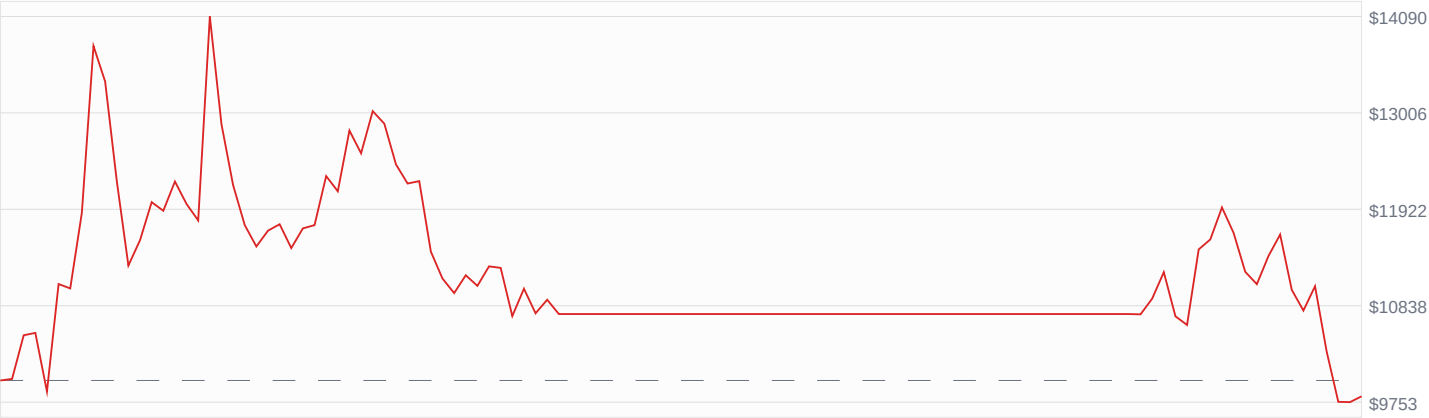




Backtest #37290 · LDO/USD · LDO/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-1.84%	0.22	50.0%	-30.78%

EQUITY CURVE118 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de LDO/USD muestra un rendimiento negativo del 1.84% con una tasa de win del 50% debido a una muestra crítica de solo dos operaciones, lo que invalida cualquier conclusión estadística sobre la estrategia. La relación de Sharpe de 0.22 y la caída máxima del 30.78% indican una gestión de riesgo ineficaz en este periodo específico de mercado. Los datos actuales no permiten discernir entre ruido estadístico y una falla estructural en la lógica de toma de decisiones de la estrategia TS-Momentum. Se requiere recopilar al menos cien operaciones con intervalos de tiempo variados para validar la robustez del modelo antes de cualquier despliegue real.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-2.75%
Sortino Ratio	0.21
Turnover	6.20x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9818.74