



Backtest #38048 · 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 ineficiencia crítica con una pérdida del 32.47% y una tasa de ganancias de solo el 33.3%, lo que indica que la estrategia de momentum no logró capturar tendencias sostenibles en este conjunto de datos. Con apenas tres operaciones totales, los estadísticos alertan que cualquier métrica de rentabilidad o riesgo carece de confianza significativa, haciendo imposible distinguir entre un fracaso estructural y una varianza aleatoria. La caída máxima del 37.64% sugiere que la gestión de capital actual es demasiado agresiva para los movimientos inherentes del par cripto. Se requiere ampliar el horizonte temporal del backtest con al menos 500 operaciones para obtener una muestra estadísticamente

ADDITIONAL METRICS

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