



Backtest #3907 · ADA/USD · ADA/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| ROI    | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -2.17% | -0.07  | 50.0%    | -23.59%      |

EQUITY CURVE122 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de ADA/USD muestra un ROI negativo del 2.17% y un Sharpe ratio de -0.07, lo que indica un rendimiento ajustado al riesgo prácticamente nulo y pérdidas netas. Con una tasa de aciertos del 50% y una caída máxima del 23.59%, la estrategia carece de edge estadístico y sudrawdown es excesivo para el capital erosionado. Sin embargo, con solo dos operaciones, la muestra es insuficiente para establecer confianza estadística o descartar el algoritmo definitivamente. El riesgo de sobreajuste es alto dada la pequeña cantidad de datos y la ausencia de diversificación temporal. Se recomienda ejecutar un backtest extendido con al menos 500 trades para validar la robustez antes de considerar cualquier implementación real.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | -3.17%     |
| Sortino Ratio   | -0.04      |
| Turnover        | 5.42x      |
| Total Trades    | 2          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$9785.62  |