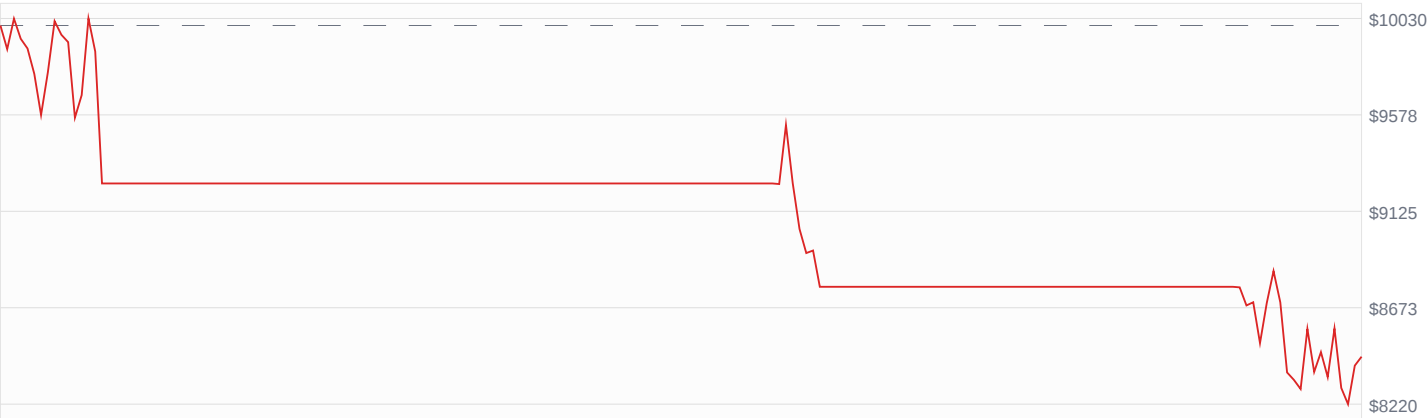




Backtest #50996 · BCH/USD · BCH/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-15.57%	-1.28	0.0%	-18.04%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de BCH/USD bajo la estrategia TS-Momentum muestra una ineficiencia crítica con una tasa de ganancia del 0% y un retorno negativo del 15.57% en solo tres operaciones, lo que sugiere una falta de adaptación a la volatilidad actual del activo. La relación de Sharpe de -1.28 y una caída máxima del 18.04% indican que el riesgo no fue compensado adecuadamente por el rendimiento, resultando en una pérdida de capital del 15.6%. Con un tamaño de muestra tan limitado, cualquier conclusión estadística carece de potencia, ya que el resultado puede ser una anomalía del corto plazo más que una falla estructural del modelo. Se requiere expandir la ventana de pruebas a periodos que incluyan regímenes de mercado más amplios para validar si la

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-15.57%
Sortino Ratio	-0.58
Turnover	5.45x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8443.11