



Backtest #55101 · BTC/USD · BTC/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

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 BTC/USD con TS-Momentum muestra un fracaso total, con una tasa de acierto del 0% y una pérdida del 26.21% en solo cinco operaciones. Un ratio de Sharpe negativo de -1.77 y un máximo de caída del 27% indican que la señal de momentum no superó el ruido del mercado en este periodo. La muestra reducida de cinco trades carece de poder estadístico para validar la estrategia en condiciones normales. Se requiere ampliar el periodo de prueba y ajustar los umbrales de entrada para filtrar las condiciones de alta volatilidad actuales. La estrategia en su estado actual no es viable para despliegue institucional sin reingeniería completa de los criterios de confirmación.

ADDITIONAL METRICS

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