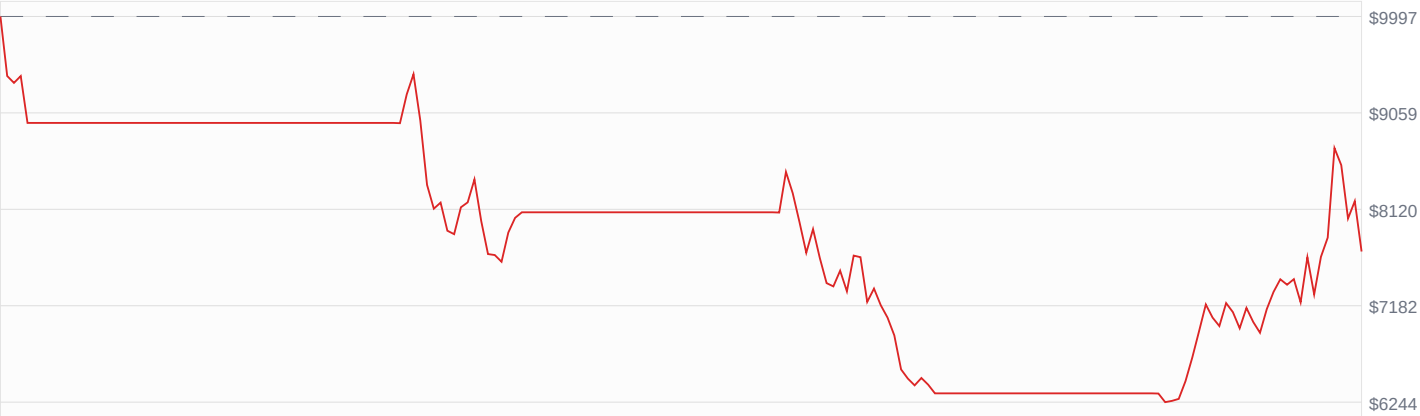




Backtest #56613 · UNI/USD · UNI/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-22.93%	-0.83	25.0%	-37.56%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de UNI/USD muestra una señalización ineficaz con una tasa de éxito del 25% y un drawdown máximo del 37.56%, indicando que la estrategia de momentum capturó principalmente movimientos adversos. Con solo cuatro operaciones, la muestra es demasiado pequeña para descartar la estrategia, pero los resultados actuales sugieren una falta de alineación con la volatilidad reciente del activo. La relación de Sharpe negativa de -0.83 confirma que el riesgo asumido no se compensó con retornos ajustados, lo que valida la necesidad de ajustar los parámetros de entrada. Es imperativo ampliar el periodo de prueba para obtener una estadística robusta antes de cualquier despliegue operativo. De momento, la estrategia debe mantenerse en

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-22.93%
Sortino Ratio	-0.54
Turnover	6.45x
Total Trades	4
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$7709.69