



Backtest #57503 · PEPE/USD · PEPE/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-43.79%	-2.22	33.3%	-47.27%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de PEPE/USD muestra una ineficacia operativa severa, con un ROI negativo del 43.79% y un ratio de Sharpe de -2.22 que indica un rendimiento por unidad de riesgo completamente inaceptable. La estrategia de momentum a 24/7 falló al capturar solo tres operaciones con una tasa de ganancia del 33.3%, resultando en una caída máxima de capital del 47.27%. La falta de señales robustas sugiere que el modelo no se adapta a la volatilidad de alta frecuencia de este activo específico sin filtros adicionales. Dada la baja muestra de operaciones, cualquier conclusión estadística carece de poder suficiente para validar la estrategia en producción. El siguiente paso crítico es ajustar los umbrales de entrada o reducir el intervalo de muestreo

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-43.79%
Sortino Ratio	-1.24
Turnover	4.00x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$5622.57