



Backtest #57553 · LDO/USD · LDO/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-1.84%	0.22	50.0%	-30.78%

EQUITY CURVE118 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de LDO/USD con la estrategia TS-Momentum muestra una ineficiencia operativa severa, evidenciada por un retorno negativo del -1.84% y una caída máxima del 30.78%. La falta de robustez estadística es crítica, ya que solo dos operaciones no permiten discernir entre ruido de mercado y una verdadera señal, limitando cualquier conclusión sobre la relación riesgo-recompensa. Un ratio Sharpe de 0.22 indica un desempeño que no supera consistentemente el riesgo libre, sugiriendo que la estrategia actual carece de un filtro de tendencia efectivo en este activo. Ante esta muestra insuficiente, el siguiente paso obligatorio es aumentar el periodo de retroceso para generar un conjunto de datos con suficiente volumen y diversificación

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-2.75%
Sortino Ratio	0.21
Turnover	6.20x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9818.74