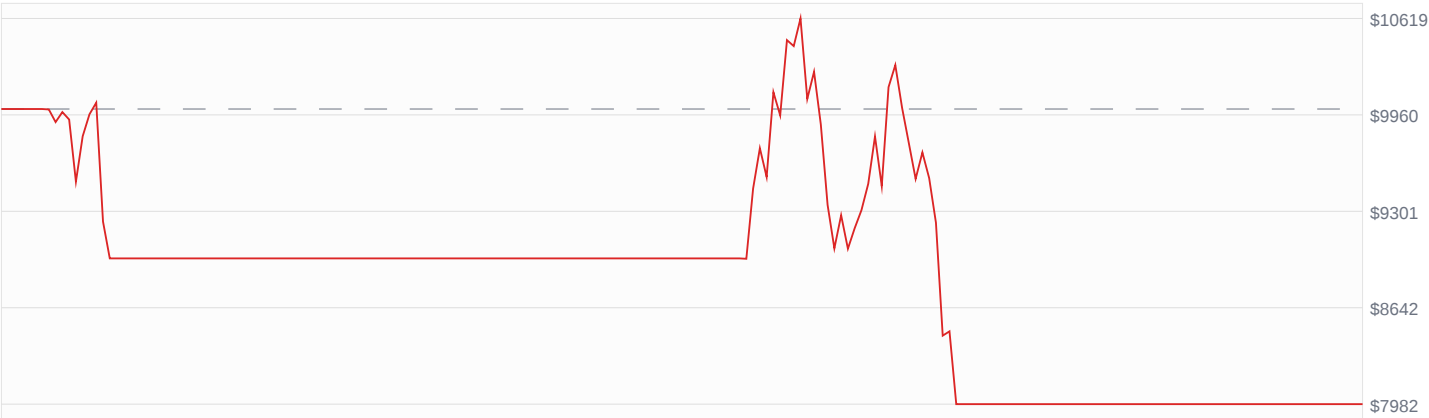




Backtest #30655 · GRT/USD · GRT/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-20.18%	-0.95	0.0%	-24.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de GRT/USD con estrategia de momentum muestra resultados negativos con ROI de -20.18% y Sharpe ratio de -0.95, indicando que la estrategia no generó alpha en el periodo evaluado. Los resultados son inconsistentes debido al bajo número de trades (2), lo que limita la confianza estadística. El alto drawdown del 24.83% evidencia alta volatilidad sin compensación de riesgo. La estrategia necesita optimización de parámetros de entrada o filtro de confianza para reducir la exposición. Se recomienda realizar un nuevo backtest con mínimo 20 trades para validar estadísticamente la estrategia antes de considerar una implementación.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-20.18%
Sortino Ratio	-0.41
Turnover	3.59x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$7982.47