



Backtest #3588 · LINK/USD · LINK/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-17.39%	-0.89	0.0%	-18.94%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia TS-Momentum falló catastróficamente con un ROI negativo del 17.39% y una tasa de aciertos del 0.0% en solo cuatro operaciones. La ausencia total de victorias indica un sesgo estructural o un entorno de mercado hostil no filtrado, agravado por un Sharpe de -0.89. La muestra es estadísticamente insignificante, pero la consistencia en las pérdidas sugiere que el algoritmo no identifica entradas válidas en este activo. El drawdown máximo del 18.94% expone al capital a riesgos innecesarios sin retorno. Se requiere reevaluar completamente los parámetros de entrada y el filtro de tendencia antes de cualquier nuevo despliegue.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-17.39%
Sortino Ratio	-0.58
Turnover	6.96x
Total Trades	4
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$8263.24