



Backtest #38109 · YFI/USD · YFI/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-15.87%	-1.02	0.0%	-21.13%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de YFI/USD muestra una ineficacia total con una tasa de victoria del 0% y una pérdida neta del 15.87% en solo tres operaciones. La estrategia de momentum no encontró ningún patrón de entrada rentable, resultando en una relación de Sharpe negativa y un drawdown máximo del 21.13%. La muestra de tres operaciones es demasiado pequeña para generar estadísticas confiables o descartar la viabilidad de la estrategia a largo plazo. Se requiere aumentar el tamaño de la muestra mediante backtesting extendido para distinguir entre mala suerte aleatoria y una lógica de señal defectuosa. El siguiente paso es ejecutar un backtest con una ventana de tiempo más amplia o ajustar los parámetros del momentum para filtrar mejor el ruido del mercado.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-15.87%
Sortino Ratio	-0.60
Turnover	5.48x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$8415.19