



Backtest #40604 · NEAR/USD · NEAR/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+11.13%	0.52	33.3%	-36.16%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El test de NEAR/USD muestra un ROI de +11.13% con solo tres operaciones, lo que indica un resultado altamente variable y poco confiable estadísticamente. Aunque la tasa de ganancia del 33.3% sugiere que el trade exitoso impulsó los números, una caída del 36.16% revela un riesgo extremo de capital que no justifica la rentabilidad superficial. La relación de Sharpe de 0.52 confirma que el rendimiento no compensa la volatilidad asumida durante el periodo de prueba. Dada la falta de muestreo y la alta exposición al riesgo, la estrategia actual es inviable para un entorno institucional. Se requiere aumentar la longitud del backtest para obtener una muestra significativa y validar la robustez de los parámetros de entrada.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	11.13%
Sortino Ratio	0.49
Turnover	5.57x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$11113.41