



Backtest #47558 · POL/USD · POL/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -26.04% | -1.45  | 0.0%     | -33.56%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de POL/USD con el sistema TS-Momentum muestra una ineficacia total, registrando una pérdida del 26% y una tasa de éxito del 0% tras solo tres operaciones. La relación de Sharpe negativa de -1.45 y el drawdown del 33.56% evidencian que la estrategia de momentum está completamente descalibrada en el entorno actual del mercado. Con tan pocas muestras, los resultados carecen de significancia estadística, aunque la señal de fracaso es contundente. Lo que funcionó fue la detección de la tendencia, pero la lógica de entrada falló al no filtrar condiciones adversas. El siguiente paso crítico es ajustar los umbrales de entrada o redefinir los criterios de filtrado para evitar exposiciones en baja.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | -26.04%    |
| Sortino Ratio   | -0.94      |
| Turnover        | 5.14x      |
| Total Trades    | 3          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$7398.15  |