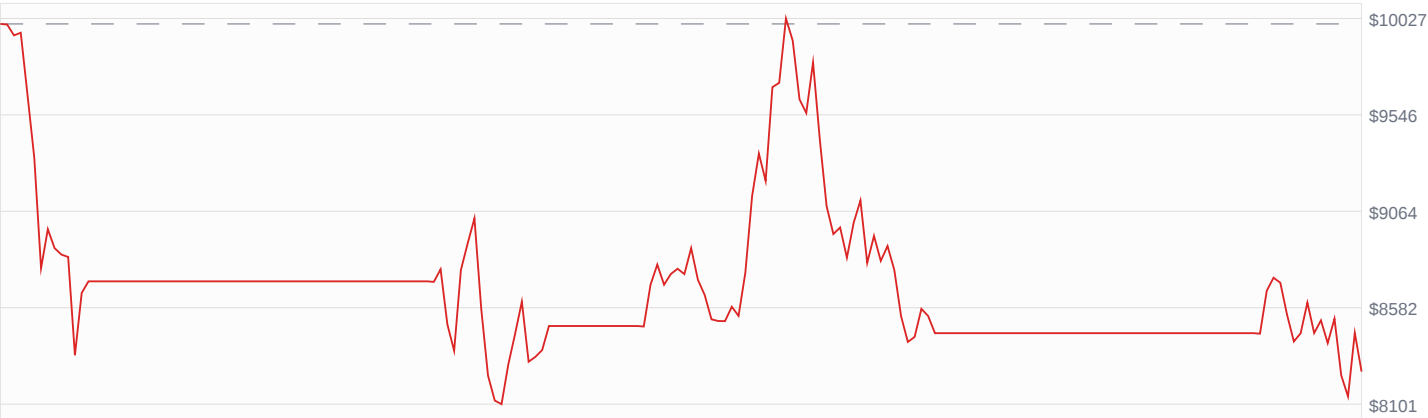




Backtest #50066 · LINK/USD · LINK/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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

El backtest de LINK/USD con la estrategia TS-Momentum presenta un desempeño negativo, registrando una pérdida del 17.39% y una tasa de acierto del 0% en solo cuatro operaciones. La relación de Sharpe de -0.89 y el drawdown máximo del 18.94% indican una falta de robustez estadística dada la muestra limitada, lo que imposibilita discernir si los resultados son una anomalía o una tendencia real. El sistema parece haber fallado al identificar correctamente la dirección del mercado en una ventana temporal tan corta, sugiriendo que los parámetros de entrada no están ajustados para la volatilidad actual de este par. Como paso concreto siguiente, se recomienda ampliar el periodo de pruebas y ajustar los umbrales de momentum para filtrar

ADDITIONAL METRICS

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