



Backtest #46635 · 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

La estrategia de momentum para POL/USD falló rotundamente con una ROI negativa del -26.04% y un Sharpe ratio de -1.45, indicando que el riesgo no fue compensado por los retornos. Con solo 3 operaciones, la muestra es demasiado pequeña para afirmar con confianza que el modelo es infructuoso, pero los resultados son claramente negativos. El drawdown máximo del 33.56% revela alta volatilidad sin protección adecuada. El win rate del 0% sugiere que todos los trades fueron perdedores. Una posible mejora sería incorporar un filtro de tendencia para evitar entradas en entornos neutros.

ADDITIONAL METRICS

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