



Backtest #50118 · 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 revela un fracaso absoluto con una tasa de ganancia del 0% y un ROI negativo de -17.39% en solo cuatro operaciones, indicando una falta total de robustez estadística. La estrategia de momentum 24/7 no logró identificar tendencias sostenibles, sufriendo un máximo de caída del 18.94% y un ratio de Sharpe de -0.89, lo que sugiere que el enfoque de mercado abierto es ineficaz para este par. Con una muestra tan pequeña, cualquier conclusión sobre el potencial futuro es especulativa y carece de valor predictivo real. Lo único funcional fue la capacidad de ejecutar órdenes, aunque la lógica de entrada fue fallida. El siguiente paso crítico es reducir la frecuencia operativa o ajustar los umbrales de momentum

ADDITIONAL METRICS

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