



Backtest #52445 · XTZ/USD · XTZ/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -34.76% | -1.40  | 0.0%     | -39.09%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia de momentum en XTZ/USD falló catastróficamente con un ROI negativo del 34.76% y un drawdown máximo del 39.09%, evidenciando una incapacidad total para capturar movimientos alcistas en un solo evento de mercado. Con un 0% de tasa de acierto y solo tres operaciones registradas, los resultados carecen de poder estadístico para validar la lógica subyacente. La métrica de Sharpe de -1.40 confirma una gestión de riesgo ineficaz que amplificó pérdidas sin protección adecuada en un entorno de baja liquidez. Es imperativo reevaluar los parámetros de entrada y salir, priorizando filtros de volumen y volatilidad antes de ejecutar en capital real.

ADDITIONAL METRICS

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| CAGR            | -34.76%   |
| Sortino Ratio   | -0.69     |
| Turnover        | 4.44x     |
| Total Trades    | 3         |
| Initial Capital | \$9997.00 |
| Final Capital   | \$6524.13 |