



Backtest #53477 · YFI/USD · YFI/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-15.87%	-1.02	0.0%	-21.13%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de YFI/USD falló completamente con un 0% de tasa de éxito y un máximo de caída del 21.13%, lo que indica una incapacidad total del sistema para capturar movimientos alcistas en esta ventana temporal. La baja confianza estadística es crítica dado que solo se ejecutaron tres operaciones, haciendo que cualquier métrica de rendimiento sea inestable y altamente susceptible a ruido aleatorio. La estrategia de momentum no pudo filtrar la volatilidad específica de YFI, resultando en una pérdida neta que erosiona significativamente el capital inicial. Como siguiente paso concreto, es imperativo reducir el tamaño de la muestra o ajustar los filtros de entrada para validar si el modelo tiene viabilidad en este par antes de desplegarlo con capital

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-15.87%
Sortino Ratio	-0.60
Turnover	5.48x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$8415.19