



Backtest #56606 · 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 muestra una estrategia de momentum ineficaz con un ROI negativo del 17.39% y una tasa de ganancia del 0%, indicando que todas las operaciones fueron perdedoras. La baja muestra de cuatro operaciones no permite establecer confianza estadística sobre los resultados, mientras que una caída máxima del 19.94% sugiere una exposición al riesgo desproporcionada durante el periodo probado. La estrategia falló al no filtrar adecuadamente las condiciones de mercado actuales, resultando en una serie de entradas en la dirección incorrecta frente a la tendencia. El siguiente paso crítico es ajustar los umbrales de entrada para exigir mayor confirmación de tendencia antes de ejecutar posiciones.

ADDITIONAL METRICS

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