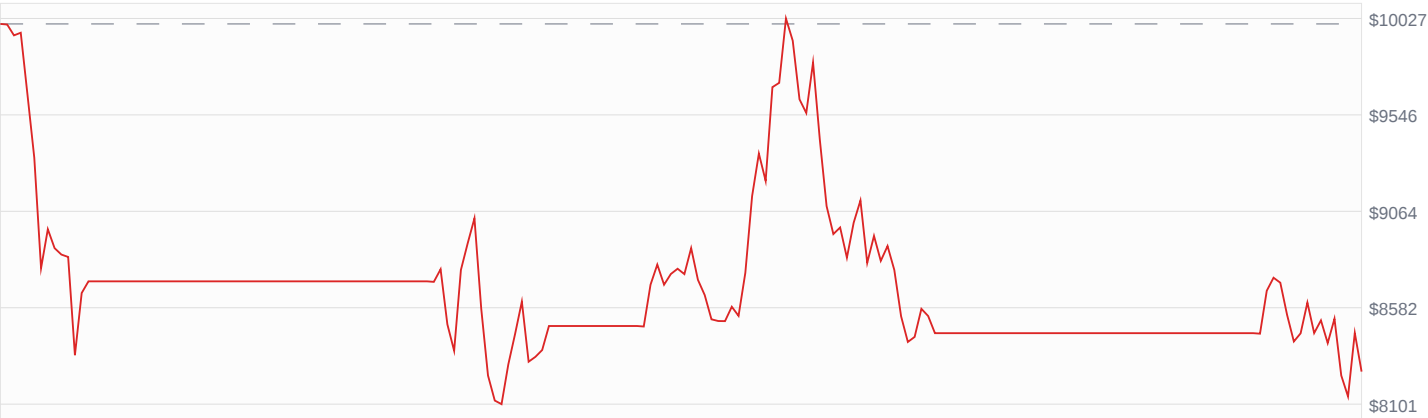




Backtest #39854 · LINK/USD · LINK/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

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 con la estrategia TS-Momentum reveló una ineficacia total, mostrando un rendimiento bruto negativo del 17.39% y una tasa de éxito del 0% en solo cuatro operaciones. La ausencia de ganancias combinada con un drawdown máximo del 18.94% sugiere que la lógica de momentum falló ante la volatilidad reciente de la red, generando señales no confirmadas. Con un ratio de Sharpe de -0.89, la estrategia no solo no protegió el capital, sino que lo erosionó sistemáticamente, lo que indica una falta de robustez estadística en una muestra tan pequeña. Es imperativo revisar los filtros de entrada para filtrar movimientos de ruido o redefinir los umbrales de momentum antes de considerar una ejecución real. La siguiente acción debe ser un

ADDITIONAL METRICS

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