



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