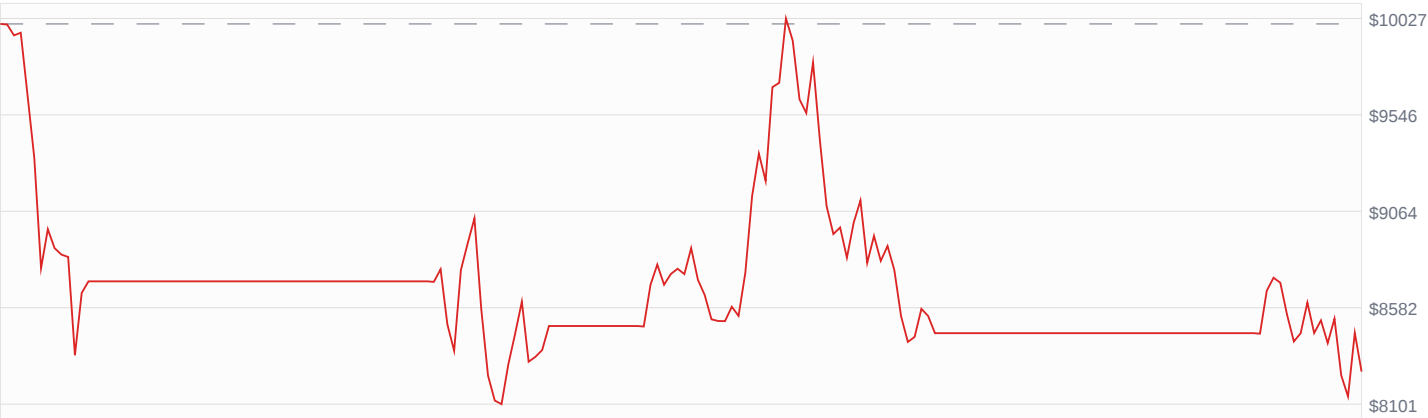




Backtest #51652 · LINK/USD · LINK/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

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 una estrategia de momentum puramente ineficaz, con una tasa de ganancia del 0% y un ROI negativo del 17.39% tras solo cuatro operaciones. La ausencia total de trades ganadores sugiere que la lógica de entrada falló sistemáticamente al capturar movimientos alcistas, mientras que el drawdown del 19% indica una exposición al riesgo desproporcionada sin protección adecuada. Dada la muestra estadística de cuatro operaciones, estos resultados carecen de significancia robusta para confirmar un patrón de mercado, aunque la tendencia negativa es preocupante. Para validar si la estrategia necesita ajustes en los parámetros de umbral o filtros de volatilidad, es imperativo ejecutar una nueva simulación con un dataset histórico más

ADDITIONAL METRICS

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