



Backtest #52445 · XTZ/USD · XTZ/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-34.76%	-1.40	0.0%	-39.09%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia de momentum en XTZ/USD falló catastróficamente con un ROI negativo del 34.76% y un drawdown máximo del 39.09%, evidenciando una incapacidad total para capturar movimientos alcistas en un solo evento de mercado. Con un 0% de tasa de acierto y solo tres operaciones registradas, los resultados carecen de poder estadístico para validar la lógica subyacente. La métrica de Sharpe de -1.40 confirma una gestión de riesgo ineficaz que amplificó pérdidas sin protección adecuada en un entorno de baja liquidez. Es imperativo reevaluar los parámetros de entrada y salir, priorizando filtros de volumen y volatilidad antes de ejecutar en capital real.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-34.76%
Sortino Ratio	-0.69
Turnover	4.44x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$6524.13