



Backtest #56301 · WIF/USD · WIF/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| ROI    | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -4.22% | -0.10  | 0.0%     | -20.65%      |

EQUITY CURVE116 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de WIF/USD con la estrategia TS-Momentum revela un fracaso total, habiendo registrado solo un trade y una tasa de ganancia del 0%, lo que invalida cualquier conclusión estadística robusta. Una caída del 20.65% en la máxima pérdida y una relación de Sharpe negativa indican que la lógica de momentum no sobrevivió a la volatilidad reciente sin filtros adecuados. La muestra de un solo evento es insuficiente para justificar la estrategia operativa, sugiriendo que la señal entró en una condición extrema de mercado contraria a la tendencia. El siguiente paso crítico es ampliar el rango de datos históricos para identificar si el umbral de entrada fue demasiado sensible o si el activo requiere un marco temporal diferente antes de cualquier

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | -6.33%     |
| Sortino Ratio   | -0.07      |
| Turnover        | 2.97x      |
| Total Trades    | 1          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$9578.16  |