



Backtest #56749 · SUSHI/USD · SUSHI/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -40.97% | -1.99  | 0.0%     | -44.36%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de SUSHI/USD con la estrategia TS-Momentum es un fracaso total, mostrando una pérdida del 41% y una tasa de victoria de 0% en solo dos operaciones. Un drawdown del 44.36% y un ratio Sharpe de -1.99 indican que el modelo no solo fue ineficaz, sino contraproducente durante el periodo simulado. La muestra de dos operaciones es estadísticamente insuficiente para validar cualquier hipótesis de trading o atribuir la falla a un factor específico del mercado. La estrategia probablemente falló por entrar en una tendencia de baja prolongada sin filtros de protección adecuados. El siguiente paso crítico es auditar el código del bot para verificar la lógica de entrada y aumentar el tamaño de la muestra antes de cualquier re-lanzamiento.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | -40.97%    |
| Sortino Ratio   | -1.02      |
| Turnover        | 3.00x      |
| Total Trades    | 2          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$5902.92  |