



Backtest #36843 · AVAX/USD · AVAX/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-31.90%	-1.70	25.0%	-36.32%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AVAX/USD con la estrategia TS-Momentum muestra una pérdida significativa del 31.90% y una tasa de ganancia del 25%, lo que indica una falta total de eficiencia operativa en el contexto de mercado actual. Con solo cuatro operaciones ejecutadas, la muestra es demasiado pequeña para generar confianza estadística en cualquier parámetro de riesgo o rendimiento, haciendo que el ratio de Sharpe negativo de 1.70 sea un indicador más de ruido que de una tendencia estructural. La profundidad del drawdown del 36.32% sugiere que los parámetros de entrada y salida fueron demasiado agresivos para la volatilidad reciente del activo, resultando en un capital final reducido a 6810.17 dólares. Se requiere una re-optimización inmediata de los

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-31.90%
Sortino Ratio	-1.01
Turnover	5.94x
Total Trades	4
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$6810.17