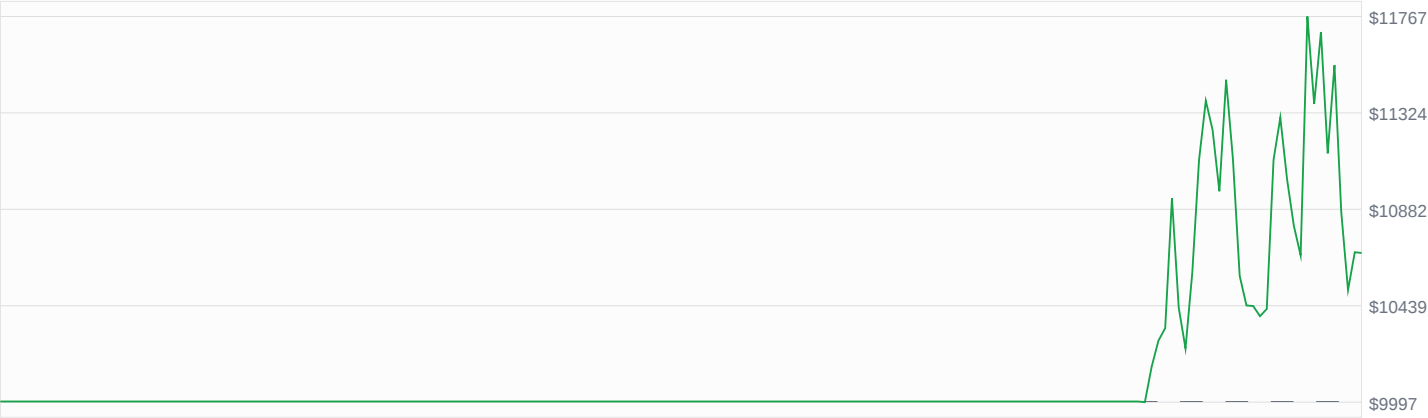




Backtest #50242 · AAVE/USD · AAVE/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| ROI    | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +6.78% | 0.47   | 100.0%   | -10.67%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AAVE/USD muestra una rentabilidad del 6.78% y un ratio de Sharpe de 0.47, aunque la tasa de ganancia del 100% se basa en un único trade, lo que invalida cualquier inferencia estadística sobre la consistencia del modelo. Un drawdown máximo del 10.67% indica que la exposición al riesgo fue alta en una sola posición, sin evidencia de gestión efectiva de capital ante volatilidad futura. La estrategia de momentum 24/7 no ha demostrado robustez fuera de este caso aislado, ya que la falta de diversidad de operaciones impide distinguir suerte de habilidad. El siguiente paso crítico es aumentar el tamaño de la muestra mediante una re-backtesting con periodos más largos y filtros adicionales para validar la estabilidad del

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 6.78%      |
| Sortino Ratio   | 0.23       |
| Turnover        | 2.07x      |
| Total Trades    | 1          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$10681.46 |