



Backtest #52383 · 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

La estrategia TS-Momentum en AVAX/USD mostró un desempeño negativo con un ROI del -31.90% y una tasa de ganancias del 25%, lo que indica una incapacidad del modelo para capturar tendencias alcistas en este período. El drawdown máximo del 36.32% refleja una falta de protección efectiva en las posiciones perdidas, mientras que una relación de Sharpe de -1.70 sugiere que el riesgo superó consistentemente al retorno. Con solo cuatro operaciones registradas, la muestra es estadísticamente insuficiente para inferir confiabilidad o validación robusta de la señal de momentum en este activo. El bajo número de trades sugiere que los parámetros de entrada o los filtros de volumen pueden estar demasiado estrictos para el comportamiento actual del mercado.

ADDITIONAL METRICS

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