



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