



Backtest #35989 · SOL/USD · SOL/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-45.15%	-2.49	0.0%	-46.26%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de SOL/USD con la estrategia TS-Momentum muestra un fracaso total, registrando un ROI negativo del 45.15% y una tasa de ganancia del 0%. Un ratio de Sharpe de -2.49 y una caída máxima del 46.26% indican una posición de riesgo inaceptable para capital institucional. Con solo cuatro operaciones, los resultados carecen de validez estadística y son insuficientes para inferir tendencias de mercado reales. La estrategia de momentum puro sin filtros de volatilidad falló en capturar la dirección del activo en este periodo. El siguiente paso crítico es ajustar el tamaño de la posición y reintroducir filtros de volumen antes de cualquier replanteamiento.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-45.15%
Sortino Ratio	-1.51
Turnover	5.31x
Total Trades	4
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$5486.48