



Backtest #48637 · 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 una ineficacia crítica, registrando una pérdida neta del 45.15% y un ratio de Sharpe negativo de 2.49 sobre una muestra insuficiente de solo cuatro operaciones. La tasa de éxito del 0% y un máximo de caída del 46.26% indican que las señales de momentum no filtraron adecuadamente la volatilidad extrema del activo. Dada la estadística limitada, cualquier conclusión sobre la viabilidad del modelo carece de poder robusto y requiere validación con datos de mayor longitud. La prioridad inmediata es reevaluar los umbrales de entrada y salida para evitar exposición innecesaria en mercados laterales.

ADDITIONAL METRICS

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