



Backtest #5021 · 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 NOTEHera local LLM

El backtest de SOL/USD muestra un fracaso estructural: un ROI de -45.15% y un Sharpe de -2.49 indican que el modelo no solo perdió capital, sino que lo hizo de forma consistente y predecible. Lo más alarmante es un win rate del 0.0% en solo 4 operaciones, lo que revela que el sistema no identificó ninguna entrada rentable, sugiriendo una falla crítica en la lógica de señal o en la gestión de riesgo. Con una muestra tan pequeña, la confianza estadística es nula; no podemos asumir que la estrategia es inherentemente mala, pero sí que está completamente rota en su configuración actual. La drawdown máxima del 46.26% confirma que el riesgo no fue contenido, erosionando más de la mitad del capital inicial. El siguiente paso obligatorio es

ADDITIONAL METRICS

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