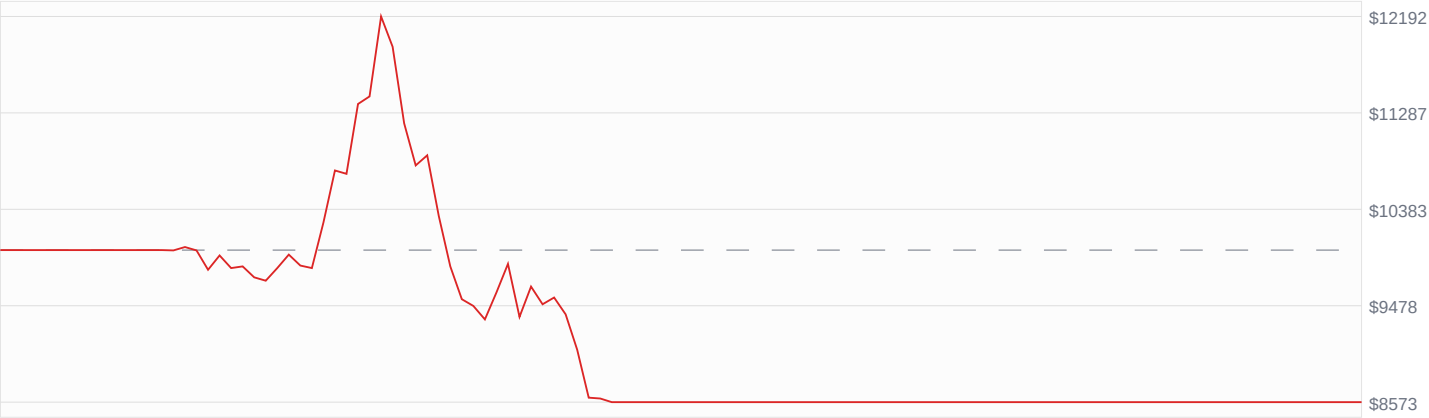




Backtest #37268 · BONK/USD · BONK/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-14.27%	-1.08	0.0%	-29.68%

EQUITY CURVE119 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de BONK/USD muestra un fracaso total con una tasa de éxito del 0% y una caída máxima del 29.68%, indicando una señal de entrada errónea en un mercado bajista. La relación de Sharpe negativa de -1.08 y el ROI de -14.27% demuestran que la estrategia de momentum no pudo capturar volatilidad favorable. La estadística es irrelevante al contar solo una operación, lo que impide calcular cualquier nivel de confianza o significancia del resultado. Se requiere ampliar la muestra con backtests históricos más largos para validar la lógica del cruce de medias móviles. La siguiente acción es ajustar los parámetros de RSI o volumen para filtrar entradas en momentos de baja liquidez.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-20.51%
Sortino Ratio	-0.65
Turnover	2.77x
Total Trades	1
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$8573.05