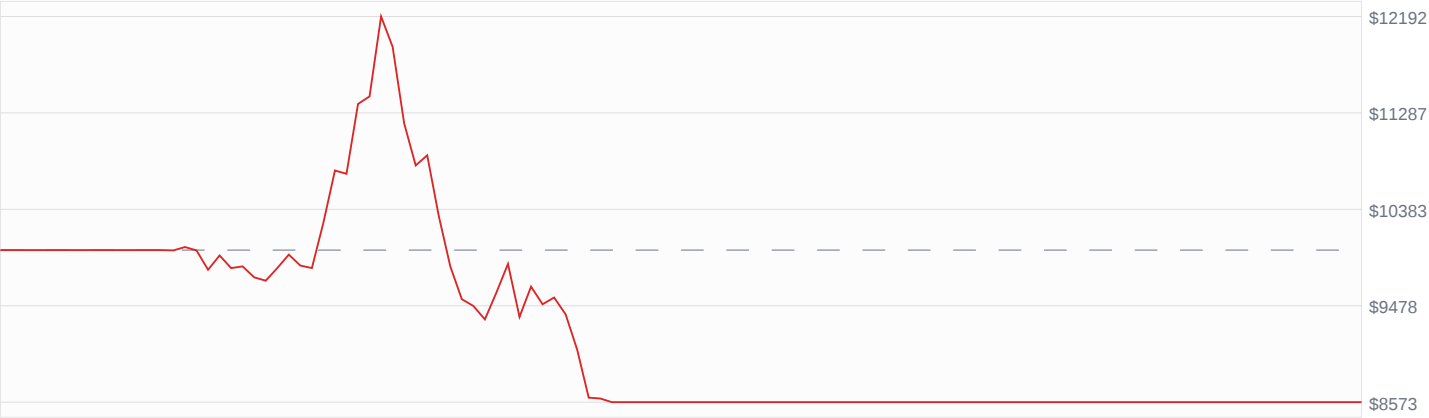




Backtest #48699 · BONK/USD · BONK/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

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 absoluto con un win rate del 0% y una caída máxima del 29.68%, lo que indica que el único trade ejecutado fue una pérdida catastrófica. La relación de Sharpe de -1.08 confirma que la estrategia generó un riesgo excesivo por unidad de retorno, sin margen de seguridad estadística alguna. Con apenas una operación en la muestra, cualquier conclusión sobre la viabilidad del momentum TS-24/7 es especulativa y carece de validez estadística. La falta de filtrado de rango o condiciones de mercado específicas probablemente expuso el capital a volatilidad extrema sin protección. El siguiente paso crítico es analizar el contexto de mercado durante esa única ejecución para ajustar los parámetros de entrada y evitar

ADDITIONAL METRICS

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