



Backtest #35852 · 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 con la estrategia TS-Momentum exhibe un desempeño crítico, evidenciado por un ROI negativo del 14.27% y una tasa de éxito del 0.0% tras ejecutar únicamente una sola operación. La ausencia de ganadores junto con un drawdown máximo del 29.68% y un ratio de Sharpe de -1.08 sugieren que la lógica de momentum no logró identificar condiciones de mercado favorables en este periodo. Con una muestra tan limitada de un solo trade, cualquier conclusión estadística es inválida y el resultado carece de confiabilidad predictiva para la implementación real. El siguiente paso obligatorio es ampliar el historial de pruebas a al menos 100 operaciones o ajustar los filtros de entrada para filtrar señales de baja calidad.

ADDITIONAL METRICS

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