



Backtest #38069 · 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 colapso total con cero ganancias en una sola operación, evidenciando una ineficacia operativa crítica. La estrategia de momentum 24/7 falló al no identificar un punto de entrada válido, resultando en un drawdown del 29.68% y una relación de Sharpe negativa. Con solo un trade en el historial, la señal es estadísticamente insignificante y carece de cualquier valor predictivo para la toma de decisiones. El enfoque de operar sin filtros de confirmación en mercados volátiles demostró ser contraproducente para este activo. La siguiente acción debe ser recalcular los umbrales de entrada y añadir filtros de volumen antes de ejecutar nuevas simulaciones.

ADDITIONAL METRICS

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