



Backtest #47035 · 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 muestra una ineficacia total, registrando un ROI negativo del -14.27% y una tasa de éxito del 0% en un único comercio. La ausencia de victorias y un ratio de Sharpe de -1.08 indican que el impulso detectado no superó los costos de transacción o provocó una pérdida inmediata. Con solo una operación en la muestra, los resultados carecen de significancia estadística y no permiten inferir patrones de mercado o fallos sistémicos de la lógica. La profundidad del drawdown del 29.68% sugiere que el precio del activo se movió en contra de la dirección señalada casi instantáneamente. El paso inmediato es auditar el umbral de entrada de momentum para filtrar volatilidades extremas o simplemente

ADDITIONAL METRICS

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