



Backtest #47036 · 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 resultado categóricamente negativo, con una tasa de ganancia del 0% y una pérdida total del capital inicial. La estrategia de momentum falló al generar un único trade en 24/7, lo que revela una falta crítica de señales y una incapacidad para capturar el movimiento del mercado. Con solo una ejecución, los resultados carecen de confianza estadística y no permiten evaluar la robustez del modelo ante condiciones de mercado variadas. El drawdown del 29.68% indica una exposición extrema sin diversificación o gestión de riesgo adecuada en este periodo específico. Como paso siguiente, se debe ampliar el periodo de backtesting y ajustar los umbrales de entrada para reducir la frecuencia de operaciones vacías.

ADDITIONAL METRICS

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