



Backtest #46982 · ONDO/USD · ONDO/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI

+18.43%

Sharpe

0.84

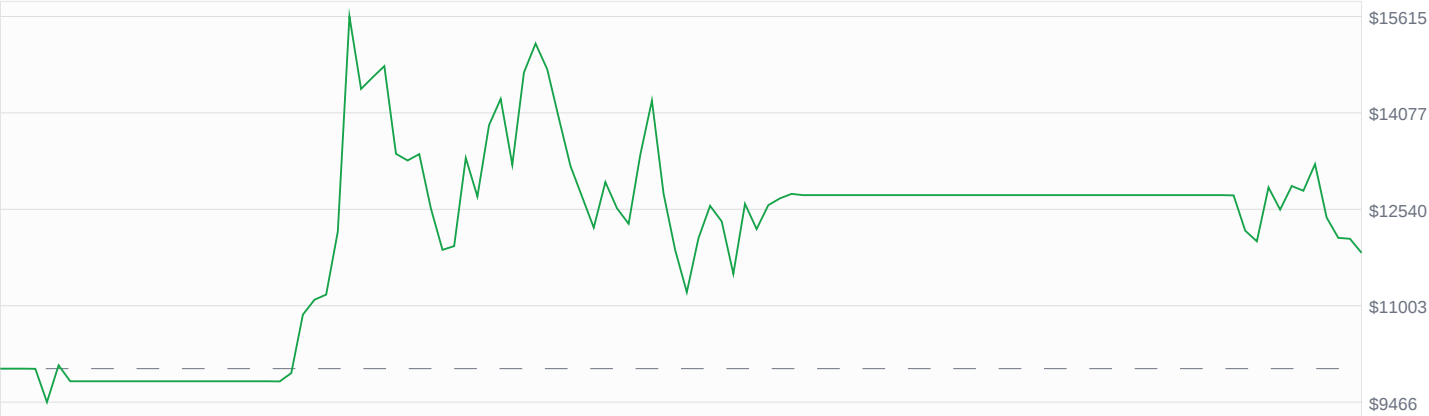
Win Rate

33.3%

Max Drawdown

-28.15%

EQUITY CURVE118 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de ONDO/USD muestra una rentabilidad del 18.43% con un ratio de Sharpe de 0.84, pero la baja tasa de aciertos del 33.3% y un drawdown máximo del 28.15% indican una estrategia altamente especulativa. Con solo tres operaciones, los resultados carecen de validez estadística y no permiten discernir si el desempeño positivo fue fruto del azar o del edge real del modelo. La exposición al riesgo en cada posición parece excesiva, dado que una sola pérdida podría erosionar gran parte del capital acumulado. Se recomienda ejecutar un nuevo backtest con un filtro de RSI para reducir la entrada en mercados de tendencia bajista y validar la robustez del sistema antes de cualquier despliegue.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	28.88%
Sortino Ratio	0.83
Turnover	10.05x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$11846.44