



Backtest #57551 · OKE · OKE · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+17.69%	0.99	33.3%	-12.27%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest del par OKE muestra una ganancia neta del 17.69% con un ratio de Sharpe de 0.99, pero la estrategia de media móvil zen sufre de una tasa de éxito del 33.3% y un máximo de caída del 12.27%. Con solo tres operaciones registradas, los resultados carecen de robustestad estadística y no permiten descartar la pura suerte o un sesgo de sobreajuste en un volumen tan bajo. La baja frecuencia sugiere que el filtro de reversiones puede estar demasiado ajustado al ruido actual del activo en lugar de capturar tendencias reales. Se requiere aumentar el tamaño de muestra mediante una prueba en un periodo histórico más amplio o ajustar los parámetros de la media móvil para reducir la ineficiencia en la entrada.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	17.69%
Sortino Ratio	0.79
Turnover	7.13x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$11772.64