



Backtest #23514 · ONDO/USD · ONDO/USD · GG5_Stochastic_Oversold (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+18.43%	0.84	33.3%	-28.15%

EQUITY CURVE118 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de ONDO muestra un ROI positivo del 18.43% con una Sharpe de 0.84, pero la tasa de acierto de solo 33.3% y una caída máxima severa del 28.15% revelan un perfil de riesgo inaceptable para capital institucional. Con apenas tres operaciones, la muestra carece de validez estadística y no permite inferir la robustez del algoritmo en distintos regímenes de mercado. La estrategia parece depender de eventos raros o suerte temporal en lugar de una ventaja cuantitativa consistente. Es imperativo ejecutar una simulación extensa con al menos 100 trades para validar la significancia de los resultados. Solo tras lograr una muestra representativa se podrá evaluar si la estrategia tiene alfa real o es simplemente ruido.

ADDITIONAL METRICS

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