



Backtest #37288 · 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 de OKE muestra un ROI del 17.69% con una tasa de win del 33.3% en solo tres operaciones, lo que indica una alta volatilidad y un riesgo concentrado. La estrategia de mean reversion funcionó en momentos específicos, pero la baja frecuencia de trades y el drawdown del 12.27% sugieren falta de robustez ante regímenes de mercado distintos. Con una muestra tan pequeña, los resultados carecen de poder estadístico significativo y no permiten validar la consistencia de la estrategia. El ratio de Sharpe de 0.99 es moderado, reflejando un retorno ajustado al riesgo que podría mejorar con mayor volumen de datos. El siguiente paso crítico es ejecutar un backtest extendido con más datos históricos para evaluar la estabilidad de los

ADDITIONAL METRICS

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