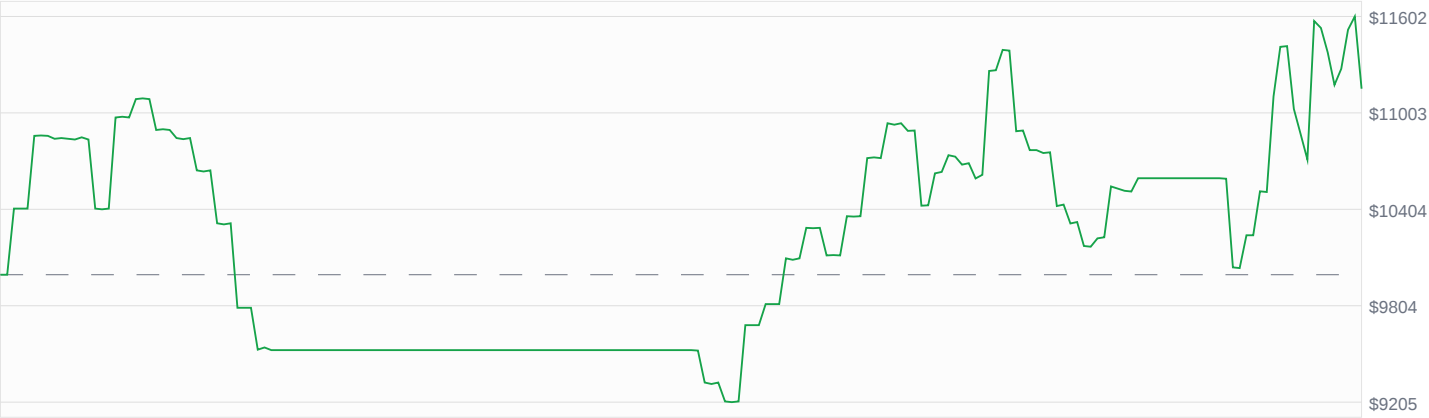




Backtest #55946 · RELY · RELY · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+11.50%	0.67	66.7%	-16.27%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de Zen Mean Reversion en RELY muestra un ROI del 11.50% y una tasa de ganancia del 66.7%, pero solo 3 operaciones no generan suficiente confianza estadística para validar la estrategia. El ratio de Sharpe de 0.67 y una caída máxima del 16.27% sugieren un perfil de riesgo elevado con baja consistencia a largo plazo. Se necesita un mayor volumen de datos o un ajuste de parámetros para reducir la volatilidad y confirmar la robustez del modelo. Recomendaría ejecutar un backtest con un periodo más amplio o en múltiples activos correlacionados antes de considerar su implementación real.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	11.50%
Sortino Ratio	0.61
Turnover	6.14x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$11153.14