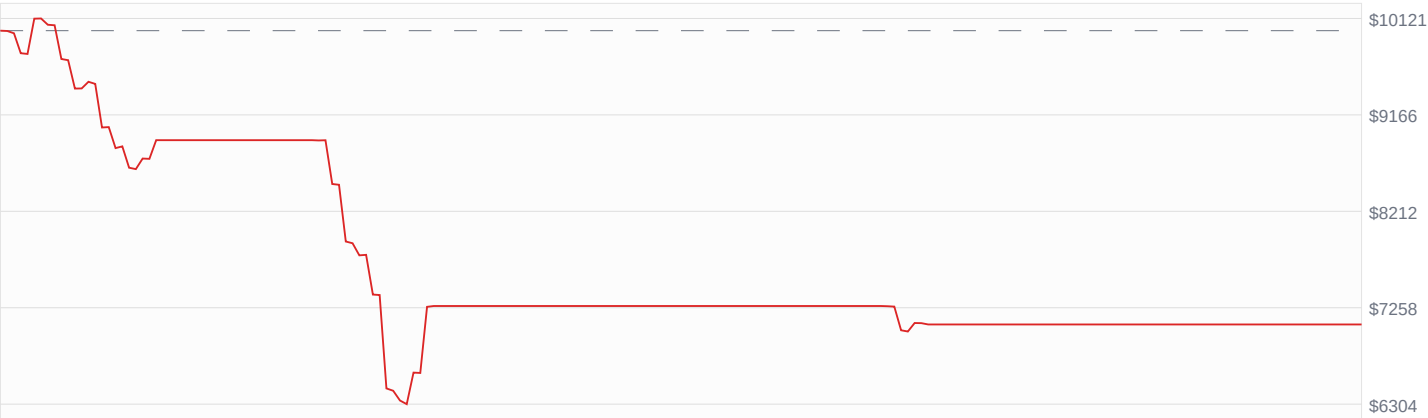




Backtest #44569 · BAT/USD · BAT/USD · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-29.08%	-1.67	0.0%	-37.71%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de BAT/USD con estrategia Zen Mean Reversion muestra una falla crítica: ROI negativo del 29.08% y Sharpe negativo de -1.67, indicando que el retorno no compensa el riesgo. La tasa de ganancia nula (0.0%) y un drawdown máximo del 37.71% sugieren que el modelo no identificó correctamente los puntos de reversión. Con solo 3 operaciones, la muestra es demasiado pequeña para confiar estadísticamente en los resultados. El modelo necesita ajuste en los parámetros de desviación estándar o inclusión de filtros de tendencia. Una próxima iteración debe incluir backtesting en más activos para validar la estrategia antes de implementarla en producción.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-29.08%
Sortino Ratio	-0.83
Turnover	4.95x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$7092.43