



Backtest #44579 · SM · SM · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+41.20%	1.21	100.0%	-32.83%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de SM muestra una rentabilidad del 41.20% y una tasa de win del 100%, pero con solo dos operaciones, la estadística carece de confianza para validar la estrategia. Una caída del 32.83% en el máximo drawdown indica que las entradas en contra de la tendencia son extremadamente riesgosas en este activo. La alta rentabilidad es un artefacto del bajo volumen de pruebas y no garantiza resultados futuros. Se requiere un backtest extendido con al menos 500 operaciones para determinar si el modelo de reversion a la media es robusto.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	41.20%
Sortino Ratio	0.94
Turnover	4.92x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$14124.38