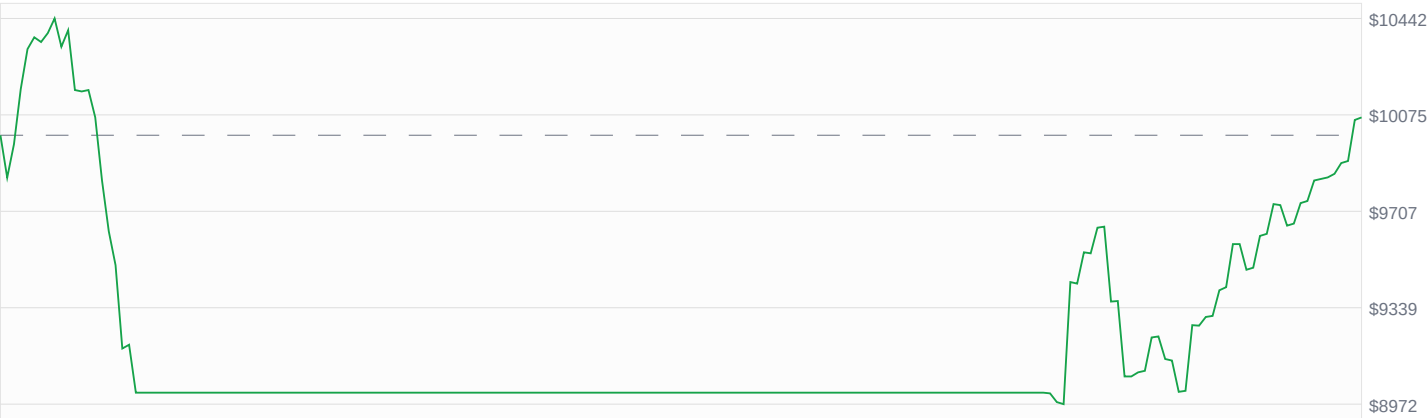




Backtest #52789 · T · T · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+0.62%	0.13	50.0%	-14.08%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de T para la estrategia de media reversion muestra un retorno marginal del 0.62% con un ratio de Sharpe bajo de 0.13, indicando una ineficiencia en la generación de alfa ajustada al riesgo. Con solo dos operaciones ejecutadas, los resultados carecen de validez estadística y la tasa de ganancia del 50% no es significativa. La pérdida máxima del 14.08% sugiere una falta de protección de capital en escenarios de reversion prolongada. La falta de muestras impide cualquier conclusión sólida sobre la robustez del modelo frente al ruido del mercado. El paso siguiente es ampliar el período de prueba o ajustar los parámetros de entrada para generar un historial de operaciones suficiente antes de considerar despliegue.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	0.62%
Sortino Ratio	0.07
Turnover	3.81x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10064.99