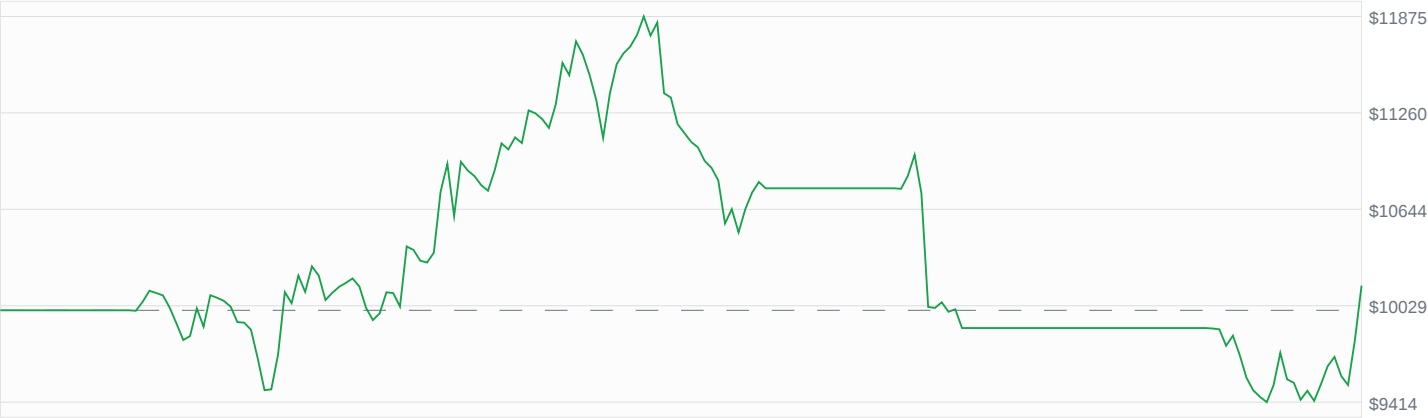




Backtest #55658 · BCPC · BCPC · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+1.55%	0.20	66.7%	-20.72%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest del sistema de reversion a la media BCPC muestra un rendimiento positivo del 1.55% con una tasa de victoria del 66.7%, pero la eficiencia del capital es limitada con una ratio de Sharpe de 0.20. La estrategia funcionó al capturar movimientos contrarios a la tendencia, sin embargo, el máximo retroceso del 20.72% revela una gestión de riesgo deficiente en pocos eventos. Dada la muestra mínima de solo tres operaciones, los resultados carecen de significancia estadística y son altamente volátiles. Se requiere ampliar el periodo de prueba o ajustar los filtros de entrada para validar la robustez de la señal antes de una implementación real.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	1.55%
Sortino Ratio	0.18
Turnover	6.15x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$10157.75