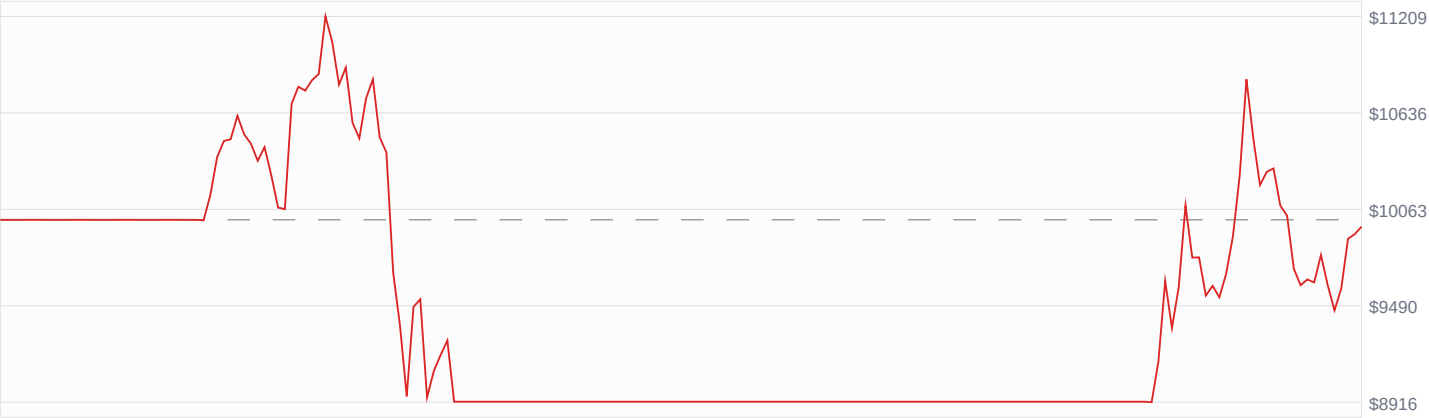




Backtest #55737 · CRAI · CRAI · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-0.43%	0.10	50.0%	-20.45%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de la estrategia Zen Mean Reversion en CRAI muestra resultados no viables, con un ROI negativo del 0.43% y una relación Sharpe de 0.10 que indica un rendimiento inferior al riesgo libre. El drawdown máximo del 20.45% con solo dos operaciones ejecutadas revela una muestra estadísticamente insuficiente para generar confianza en los indicadores de rentabilidad reportados. La tasa de victorias del 50% sugiere que la estrategia no supera el mercado por azar, pero la falta de volumen real impide discernir si el algoritmo de reversión a la media es funcional en este activo. Se requiere aumentar el tamaño de la muestra mediante pruebas en periodos de mayor volatilidad para validar la lógica subyacente antes de cualquier despliegue de

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-0.43%
Sortino Ratio	0.06
Turnover	3.78x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9959.84