



Backtest #45161 · CPK · CPK · Zen Mean Reversion (auto)

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| ROI    | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -6.67% | -0.57  | 33.3%    | -14.06%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia de reverencia a la media en CPK falló estrepitosamente, generando un ROI negativo del 6.67% y una tasa de victorias del 33.3% tras solo tres operaciones. Un drawdown máximo del 14.06% y una ratio de Sharpe de -0.57 indican que el riesgo superó sistemáticamente al rendimiento en esta muestra. Con un tamaño de muestra tan limitado, cualquier conclusión estadística es altamente ineficaz y carece de confiabilidad operativa. Se requiere ampliar el periodo de prueba para validar si la lógica de reverencia es viable en este activo.

ADDITIONAL METRICS

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| CAGR            | -6.67%    |
| Sortino Ratio   | -0.37     |
| Turnover        | 5.71x     |
| Total Trades    | 3         |
| Initial Capital | \$9997.00 |
| Final Capital   | \$9336.14 |