



Backtest #53234 · KO · KO · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+14.47%	1.30	75.0%	-5.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de KO muestra una rentabilidad del 14.47% con un ratio de Sharpe de 1.30, lo que sugiere una estrategia de reversion a la media funcional, pero la baja de 5.60% indica una exposición significativa al riesgo en periodos de volatilidad. La tasa de éxito del 75% es estadísticamente poco fiable dado el reducido volumen de 4 operaciones ejecutadas, lo que impide confirmar la robustez del modelo ante condiciones de mercado cambiantes. Aunque el capital final alcanzó \$11,450.65, la muestra es demasiado pequeña para descartar suerte pura en lugar de habilidad algorítmica. Se requiere ampliar el periodo de prueba a al menos 100 operaciones para validar la consistencia del enfoque de reversion a la media antes de considerar una

ADDITIONAL METRICS

CAGR	14.47%
Sortino Ratio	1.30
Turnover	8.16x
Total Trades	4
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$11450.65