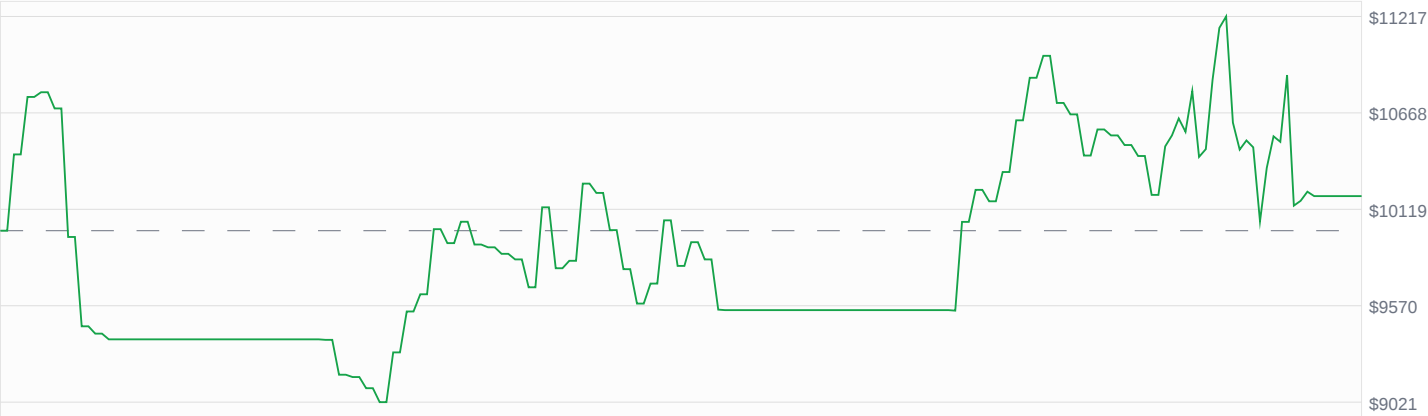




Backtest #53839 · SNDA · SNDA · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+1.94%	0.22	66.7%	-15.73%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de SNDA muestra una ganancia marginal del 1.94% con una tasa de ganancia del 66.7%, pero la baja relación de Sharpe de 0.22 indica un rendimiento ajustado al riesgo insuficiente. La estrategia de reversión a la media falló en generar suficiente alpha debido a la extrema escasez de datos, con solo tres operaciones y un máximo retroceso del 15.73% que sugiere volatilidad mal gestionada en muestras pequeñas. Con tan pocos trades, los resultados carecen de significancia estadística y no pueden generalizarse a condiciones de mercado reales. Se requiere una expansión de datos o un filtro de volatilidad más estricto para validar si la señal de reversión es robusta antes de cualquier despliegue de capital.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	1.94%
Sortino Ratio	0.18
Turnover	5.80x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10193.91