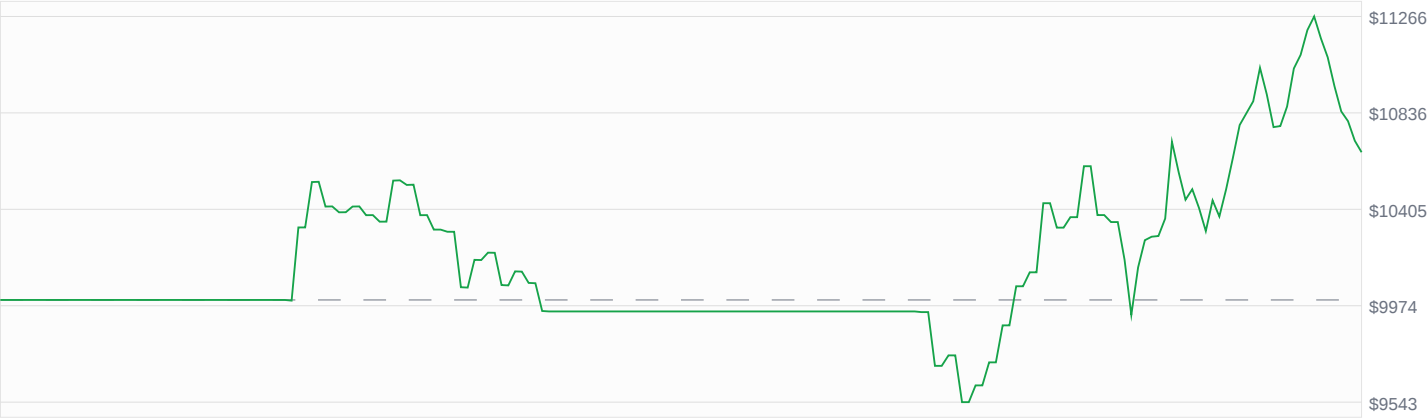




Backtest #55860 · SBCF · SBCF · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+6.57%	0.70	50.0%	-8.80%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de SBCF con la estrategia de reversion a la media muestra una rentabilidad del 6.57% y una tasa de aciertos del 50%, pero la muestra de solo dos operaciones es insuficiente para generar confianza estadística. Un ratio de Sharpe de 0.70 y un máximo de caída del 8.80% indican que el capital se expuso a riesgos significativos sin una consistencia probada. La estrategia no ha demostrado robustez ante la volatilidad real del activo, lo que sugiere que los resultados actuales son más una anomalía que una señal fiable. Se requiere ejecutar un backtest con más datos históricos o ajustar los parámetros de entrada para filtrar mejor las señales falsas antes de considerar un despliegue en vivo.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	6.57%
Sortino Ratio	0.57
Turnover	4.06x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$10659.90