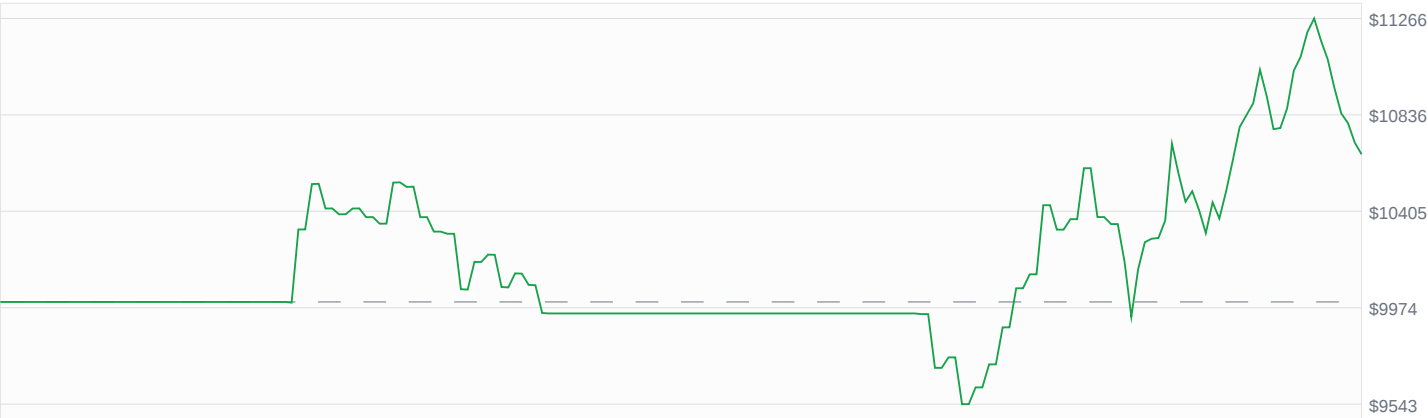




Backtest #55861 · SBCF · SBCF · Zen Mean Reversion (auto)

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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 test de SBCF muestra un retorno marginal del 6.57% con una tasa de victoria del 50%, pero la confianza estadística es inexistente al depender únicamente de dos operaciones. Un ratio de Sharpe de 0.70 y un drawdown del 8.80% indican que la estrategia de media reversion no genera suficiente consistencia para superar la volatilidad del activo. La muestra insuficiente impide validar si el enfoque de Zen funcionará ante condiciones de mercado cambiantes. La prioridad inmediata es ejecutar al menos 100 operaciones en backtesting histórico para determinar la robustez real del modelo.

ADDITIONAL METRICS

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