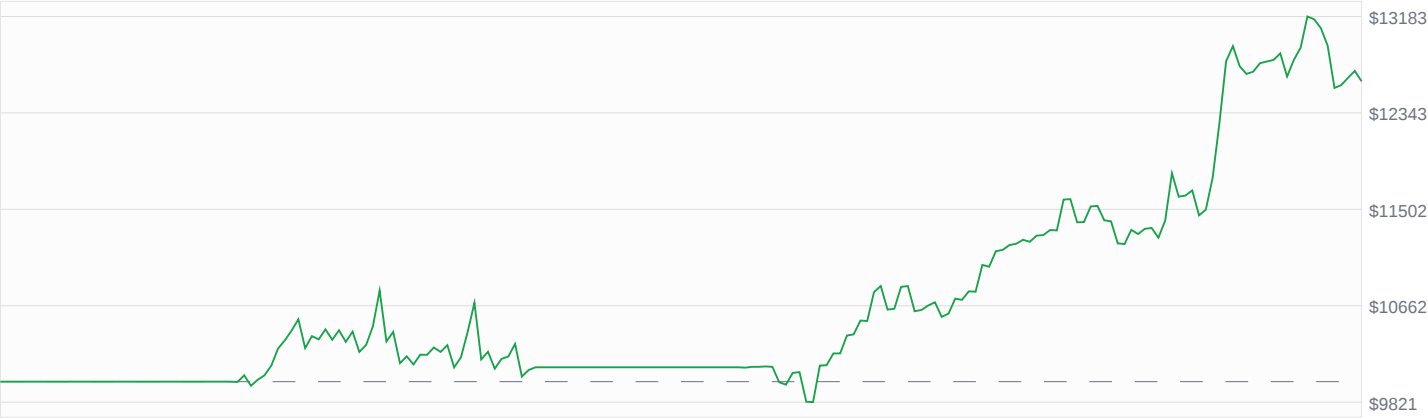




Backtest #40721 · HBT · HBT · Zen Mean Reversion (auto)

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +26.15% | 1.70   | 100.0%   | -7.38%       |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de HBT muestra un rendimiento destacado con ROI de +26.15% y Sharpe de 1.70, aunque el win rate del 100% es sospechoso dada la muestra de solo 2 operaciones, lo que limita la confianza estadística. El drawdown máximo de 7.38% indica cierta volatilidad en los movimientos. El estrategia no logró capturar un comportamiento de mean reversion efectivo en el corto plazo, y los resultados son insuficientes para validar la robustez del modelo. Se recomienda ampliar el periodo de prueba con al menos 20 operaciones para validar la consistencia del rendimiento.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 26.15%     |
| Sortino Ratio   | 1.27       |
| Turnover        | 4.29x      |
| Total Trades    | 2          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$12618.98 |