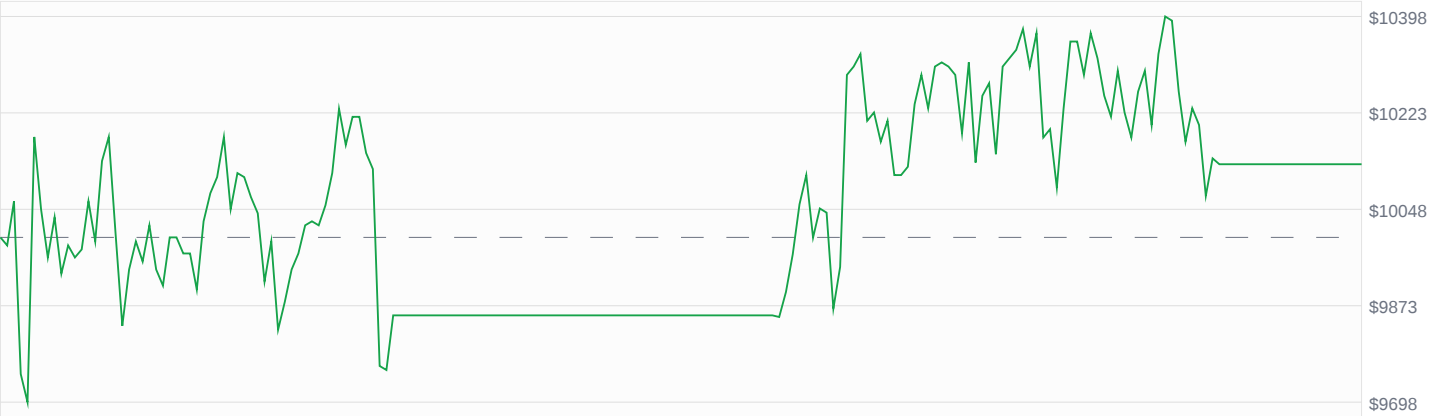




Backtest #44765 · EFC · EFC · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+1.30%	0.19	50.0%	-4.56%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de EFC muestra un rendimiento modesto de +1.30% con una proporción equilibrada de 50% de trades ganadores, pero con una volatilidad significativa indicada por el drawdown máximo del 4.56%. La baja rentabilidad y el Sharpe ratio de 0.19 sugieren que la estrategia no supera el riesgo de capital, y la muestra de solo 2 operaciones limita la confianza estadística. El modelo no logró capturar tendencias claras ni generar señales consistentes, lo que indica un riesgo de overfitting. Se recomienda aumentar el número de trades mediante una expansión del periodo de prueba o ajuste del umbral de reversiones. El bot no demostró capacidad de generar alpha en este activo.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	1.30%
Sortino Ratio	0.15
Turnover	3.98x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10129.93