



Backtest #45161 · CPK · CPK · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-6.67%	-0.57	33.3%	-14.06%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia de reverencia a la media en CPK falló estrepitosamente, generando un ROI negativo del 6.67% y una tasa de victorias del 33.3% tras solo tres operaciones. Un drawdown máximo del 14.06% y una ratio de Sharpe de -0.57 indican que el riesgo superó sistemáticamente al rendimiento en esta muestra. Con un tamaño de muestra tan limitado, cualquier conclusión estadística es altamente ineficaz y carece de confiabilidad operativa. Se requiere ampliar el periodo de prueba para validar si la lógica de reverencia es viable en este activo.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-6.67%
Sortino Ratio	-0.37
Turnover	5.71x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9336.14