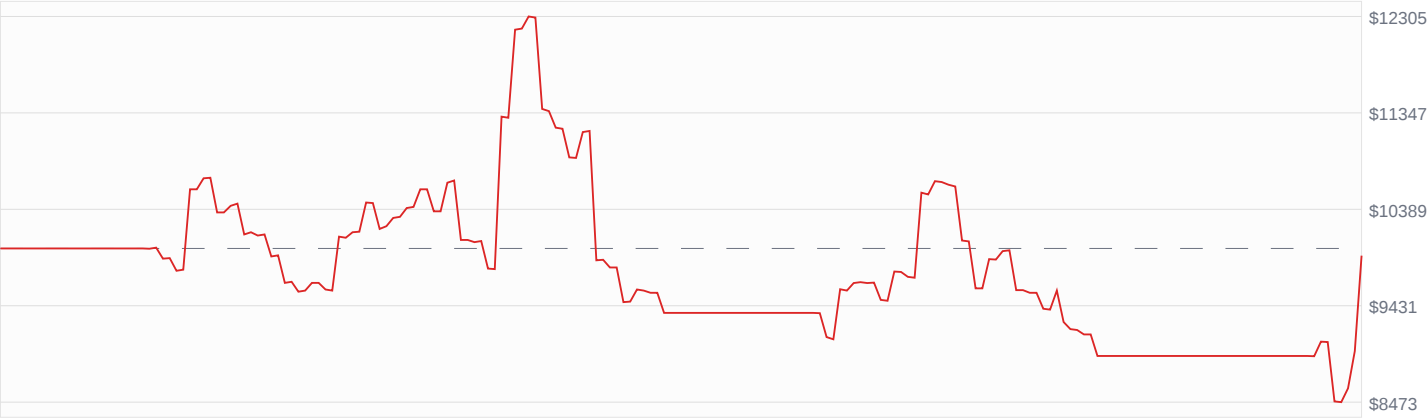




Backtest #53451 · KURA · KURA · Zen Mean Reversion (auto)

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| ROI    | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -0.74% | 0.16   | 33.3%    | -31.14%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El test de estrategia Zen Mean Reversion sobre KURA muestra resultados insostenibles con una caída del 0.74% y un ratio de Sharpe de 0.16, indicando falta de rentabilidad ajustada al riesgo. El bajo win rate del 33.3% y un drawdown máximo del 31.14% revelan una exposición excesiva a movimientos contrarios sin protección adecuada en solo tres operaciones. La estadística de la muestra es insuficiente para validar la robustez del sistema, lo que eleva la incertidumbre sobre su desempeño futuro. Se requiere aumentar el volumen de pruebas y ajustar los parámetros de salida para mitigar las pérdidas significativas observadas.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | -0.74%     |
| Sortino Ratio   | 0.15       |
| Turnover        | 5.65x      |
| Total Trades    | 3          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$9928.49  |