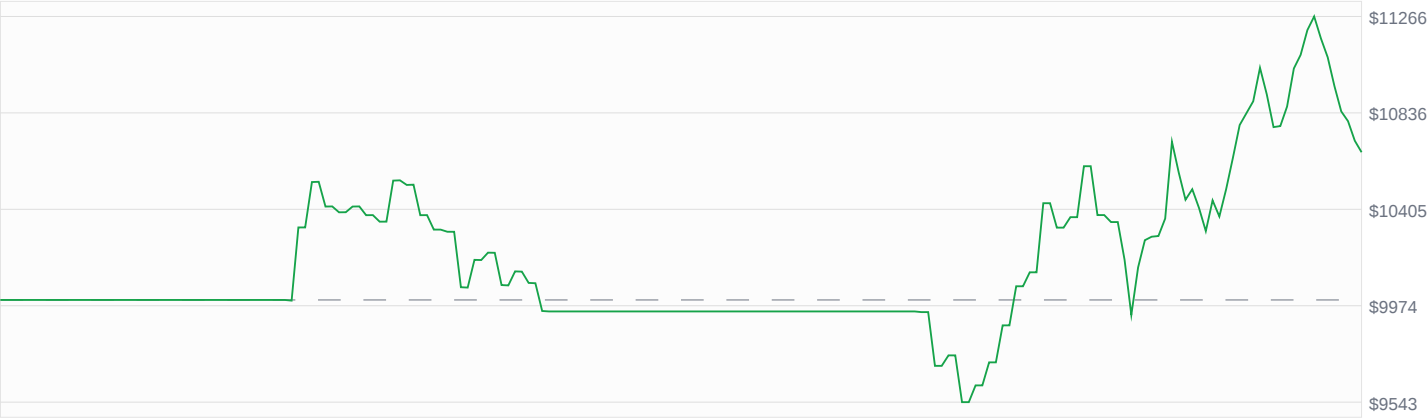




Backtest #55860 · SBCF · SBCF · Zen Mean Reversion (auto)

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 backtest de SBCF con la estrategia de reversi3n a la media muestra una rentabilidad del 6.57% y una tasa de aciertos del 50%, pero la muestra de solo dos operaciones es insuficiente para generar confianza estadística. Un ratio de Sharpe de 0.70 y un m1ximo de caída del 8.80% indican que el capital se expuso a riesgos significativos sin una consistencia probada. La estrategia no ha demostrado robustez ante la volatilidad real del activo, lo que sugiere que los resultados actuales son m1s una anomalía que una seña fiable. Se requiere ejecutar un backtest con m1s datos hist3ricos o ajustar los par1metros de entrada para filtrar mejor las señaes falsas antes de considerar un despliegue en vivo.

ADDITIONAL METRICS

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