



Backtest #55087 · CINF · CINF · Zen Mean Reversion (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-2.45%	-0.08	50.0%	-13.79%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia de reversion zen para CINF falló, generando una pérdida del 2.45% con un ratio de Sharpe negativo. Un drawdown del 13.79% y una tasa de aciertos del 50% sugieren que el modelo capturó ruido de mercado más que tendencias. La baja confiabilidad estadística por solo cuatro operaciones invalida cualquier conclusión robusta sobre su viabilidad actual. Se requiere aumentar el intervalo de análisis o ajustar los umbrales de entrada para filtrar mejor la volatilidad. No se recomienda desplegar esta configuración en capital real hasta obtener un historial significativo.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-2.45%
Sortino Ratio	-0.07
Turnover	7.87x
Total Trades	4
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9755.36