



Backtest #55086 · 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

El backtest de CINF con la estrategia Zen Mean Reversion muestra una ineficiencia operativa, registrando una pérdida del 2.45% y una ratio Sharpe negativa de -0.08. Con solo cuatro operaciones, la muestra es estadísticamente insuficiente para validar la viabilidad de la estrategia ante la volatilidad del sector. La tasa de éxito del 50% indica un enfoque aleatorio, mientras que la caída máxima del 13.79% subraya un riesgo de capital significativo sin protección adecuada. Se requiere expandir el período de pruebas o ajustar los parámetros de entrada para filtrar mejor el ruido de mercado.

ADDITIONAL METRICS

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