



Backtest #47529 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v1479

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-4.00%	-0.36	33.3%	-12.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1479 en GC=F muestra una ineficiencia operativa crítica con un ROI negativo del 4.00% y una tasa de ganancia del 33.3% sobre solo tres operaciones. La baja frecuencia de ejecución y el ratio de Sharpe de -0.36 indican que el ruido del mercado distorsiona la señal más que la estrategia. Con un máximo de caída del 12.60%, el riesgo no ajustado por el capital está demasiado alto para ser estadísticamente confiable. Antes de considerar una implementación en vivo, es imperativo aumentar el volumen de datos con un periodo de prueba extendido para validar la robustez del filtro de entrada.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-4.00%
Sortino Ratio	-0.18
Turnover	5.75x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9603.04