



Backtest #50994 · GC=F · EVO_EVOEVOEVOG_v480

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 GC=F con la estrategia EVO_EVOEVOEVOG_v480 muestra un ROI negativo del 4% y una tasa de ganancia del 33.3% en solo tres operaciones, lo que indica una falta de robustez estadística. La baja relación de Sharpe de -0.36 y el drawdown máximo del 12.6% sugieren una ineficiencia en la gestión del riesgo durante periodos de alta volatilidad del oro. Con una muestra tan pequeña, los resultados carecen de confiabilidad para inferir el rendimiento futuro o la viabilidad de la estrategia a largo plazo. Se requiere aumentar el tamaño de la muestra mediante una reoptimización de parámetros o el análisis de un periodo histórico más extenso antes de considerar ajustes.

ADDITIONAL METRICS

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