



Backtest #51762 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v899

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_v899 sobre GC=F muestra una pérdida del 4.00% y una tasa de ganancia del 33.3%, lo que indica una incapacidad clara para capturar tendencias en este conjunto de datos. Con solo tres operaciones ejecutadas, los resultados carecen de significancia estadística y no permiten inferir la robustez real del algoritmo más allá de este caso aislado. La relación de Sharpe de -0.36 y un máximo de caída del 12.60% sugieren que la gestión del riesgo actual es ineficaz para preservar capital en mercados laterales. Se requiere ampliar el historial de pruebas con mayor volumen de datos para validar si la lógica de entrada es viable antes de cualquier despliegue real.

ADDITIONAL METRICS

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