



Backtest #53940 · GC=F · EVO_EVOEVOEVOE_v1715

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 para la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v1715 muestra una pérdida neta del 4.00% con un ratio de Sharpe negativo, lo que indica una ineficiencia clara en la gestión del riesgo. Con solo tres operaciones realizadas, la baja tasa de acierto del 33.3% y la caída máxima del 12.60% reflejan un tamaño de muestra insuficiente para generar estadísticas confiables sobre la robustez del modelo. La estrategia no logró adaptar adecuadamente a las condiciones de mercado actuales, resultando en un rendimiento inferior al capital inicial. Se requiere una revisión urgente de los parámetros de entrada y salida para mejorar la selectividad de las señales. El siguiente paso crítico es ampliar el historial de pruebas o ajustar los filtros de tendencia

ADDITIONAL METRICS

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