



Backtest #28141 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v413

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+29.90%	1.34	100.0%	-17.75%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

The backtest on GC=F con EVO_GG1RSISNIP_v413 alcanza ROI +29.90%, Sharpe 1.34 y win rate 100%, pero con solo 2 trades la confianza estadística es prácticamente nula. El max drawdown del 17.75% es desproporcionado respecto al número de operaciones, lo que sugiere exposición concentrada y posible overfitting. Un win rate del 100% con dos trades no es señal de robustez, sino de muestra insuficiente para validar la estrategia. Se requiere al menos 50-100 operaciones para que el Sharpe y el ROI tengan significado estadístico. Próximos pasos: expandir el rango temporal, añadir walk-forward testing y verificar si la lógica sobrevive a regímenes de mercado distintos.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	29.90%
Sortino Ratio	1.03
Turnover	4.30x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$12990.02