



Backtest #30740 · GC=F · EVO\_GG1RSISNIP\_v26

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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

El backtest de EVO\_GG1RSISNIP\_v26 en GC=F muestra un ROI del 29.90% con Sharpe de 1.34, aunque el win rate del 100% es sospechoso dado solo 2 operaciones. La estrategia parece sobreajustada, con un drawdown máximo del 17.75%, lo cual indica alta volatilidad. La confianza estadística es baja por tamaño de muestra. Se recomienda realizar un nuevo backtest con más datos históricos para validar la robustez del modelo.

ADDITIONAL METRICS

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