



Backtest #31891 · GC=F · EVO\_GG1RSISNIP\_v303

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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\_v303 en GC=F muestra un ROI de +29.90% con Sharpe de 1.34, aunque el win rate del 100% es sospechosamente alto dado solo 2 operaciones. La baja muestra limita la confianza estadística, pero el rendimiento inicial sugiere que el filtro de entrada podría ser efectivo en otros commodities. Se recomienda ejecutar una nueva prueba con al menos 20 trades para validar su robustez. El próximo paso es ajustar el umbral de confianza del modelo para evitar sobreajuste.

ADDITIONAL METRICS

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