



Backtest #31911 · GC=F · EVO_EVOGG1RSIS_v451

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 GC=F con la estrategia EVO_EVOGG1RSIS_v451 muestra un ROI del 29.90% con Sharpe de 1.34, aunque el win rate del 100% podría ser spurious dado el tamaño muestral de solo 2 trades. El drawdown máximo del 17.75% indica alta volatilidad en condiciones de mercado extremas. Con una muestra tan limitada, la confianza estadística es baja, y se recomienda validar la estrategia con al menos 20 trades adicionales antes de considerar su implementación. La próxima acción debe ser un backtest extendido con datos históricos más amplios.

ADDITIONAL METRICS

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