



Backtest #37277 · GC=F · EVO_EVOWEBIDEA_v355

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 muestra una rentabilidad del 29.90% y una tasa de ganancia del 100%, pero con solo dos operaciones, la estadística es insuficiente para inferir robustez. La alta rentabilidad se ve comprometida por un drawdown máximo del 17.75% y una relación de Sharpe modesta del 1.34, lo que sugiere volatilidad extrema en pocos eventos. La estrategia EVO_EVOWEBIDEA_v355 funcionó en esta muestra específica, pero la falta de datos impide evaluar su comportamiento ante cambios de régimen de mercado. Se requiere una re-optimización con mayor volumen de datos o un filtrado más estricto para confirmar la viabilidad a largo plazo. El siguiente paso es ejecutar una prueba de estrés con datos de 5 años para validar la consistencia

ADDITIONAL METRICS

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