



Backtest #39209 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v1086

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

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1086 sobre el contrato de oro GC=F generó un retorno del 29.90% con una tasa de Sharpe de 1.34, aunque la rentabilidad perfecta del 100% en solo dos operaciones es estadísticamente insignificante y carece de confiabilidad. Un máximo de caída del 17.75% indica un riesgo de cola severo que no se refleja en las métricas de ganancia, sugiriendo una exposición extrema a eventos de bajo probabilidad. La muestra de datos es demasiado pequeña para validar la robustez del modelo o descartar una sobreoptimización extrema de los parámetros. Es imperativo ejecutar una prueba de estrés con al menos mil operaciones históricas para evaluar la viabilidad real de la estrategia en mercados de alta volatilidad.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	29.90%
Sortino Ratio	1.03
Turnover	4.30x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$12890.02