



Backtest #47153 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v141

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-4.00%	-0.36	33.3%	-12.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v141 en GC=F resultó ineficaz, generando una pérdida del 4% y un ratio Sharpe negativo debido a una tasa de ganancia del 33.3% sobre solo 3 operaciones. Este bajo volumen de datos carece de poder estadístico para validar la robustez del modelo, por lo que los resultados actuales carecen de confiabilidad predictiva. La pérdida máxima del 12.6% indica que el riesgo no está adecuadamente gestionado frente a la frecuencia de entrada. Se requiere recopilar más datos históricos para ajustar los parámetros de entrada y eliminar las señales falsas que provocaron la pérdida de capital.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-4.00%
Sortino Ratio	-0.18
Turnover	5.75x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9603.04