



Backtest #48231 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v1003

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

El backtest de la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1003 sobre GC=F muestra una pérdida del 4% con una tasa de aciertos del 33.3% basada en solo tres operaciones, lo que genera una muestra estadísticamente insignificante para validar el riesgo real. La relación de Sharpe negativa de -0.36 y un máximo de pérdida del 12.60% indican que el capital se deterioró significativamente sin evidencia robusta de que el modelo sea viable. Dado el tamaño de la muestra, cualquier conclusión sobre la rentabilidad futura carece de confianza estadística y podría ser producto de sobreajuste o ruido aleatorio. La estrategia requiere más iteraciones de backtesting con mayor volumen de datos para filtrar señales falsas antes de considerarse operativa. El siguiente paso

ADDITIONAL METRICS

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