



Backtest #49203 · GC=F · EVO_EVOEVOEVOE_v770

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 GC=F con la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v770 muestra una ineficiencia operativa clara, con un ROI negativo del -4.00% y una relación de Sharpe de -0.36 que indica un rendimiento por riesgo pobre. La baja tasa de aciertos del 33.3% combinada con solo 3 operaciones totales carece de significancia estadística para validar cualquier comportamiento del modelo ante el ruido del mercado. Un drawdown máximo del 12.60% revela una exposición excesiva a un único evento adverso sin mecanismos de protección adecuados. La muestra es demasiado pequeña para descartar la viabilidad futura, pero insuficiente para confirmar la robustez del algoritmo ante volatilidad cambiante. Se requiere ampliar el periodo de prueba con

ADDITIONAL METRICS

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