



Backtest #49603 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v1595

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_v1595 sobre GC=F muestra una ineficiencia operativa severa con un ROI negativo del 4.00% y una tasa de ganancia del 33.3%, lo que indica que las pérdidas superaron ampliamente a los pocos aciertos. La baja cantidad de operaciones registradas, solo tres en total, invalida cualquier conclusión estadística robusta sobre la viabilidad del modelo y sugiere que la estrategia no sobrevive en condiciones reales de mercado. El ratio de Sharpe negativo de -0.36 y la caída máxima del 12.60% reflejan una gestión de capital ineficaz o una detección de señales demasiado sensible a ruido de mercado. Ante esta falta de datos suficientes para validar la hipótesis, el siguiente paso crítico es reanudar la

ADDITIONAL METRICS

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