



Backtest #50041 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v1326

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_v1326 sobre GC=F generó un ROI negativo del -4% con un ratio de Sharpe de -0.36, lo que indica un rendimiento inferior al riesgo en esta simulación. El bajo win rate del 33.3% y el drawdown del 12.60% sugieren que la lógica de entrada no filtró adecuadamente los movimientos adversos del oro durante el período probado. La falta de 3 operaciones totales reduce drásticamente la confianza estadística, impidiendo determinar si el bajo rendimiento es un defecto de diseño o ruido del muestreo. Se requiere ampliar el rango de datos histórico para validar si la estrategia sobrevive a diferentes regímenes de mercado antes de cualquier despliegue.

ADDITIONAL METRICS

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