



Backtest #50573 · GC=F · EVO_EVOEVOEVOE_v1910

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_EVOEVOEVOE_v1910 falló en GC=F con un ROI negativo del 4% y un drawdown máximo del 12.6%, evidenciando una incapacidad para capturar volatilidad en el oro. Con solo tres operaciones, la muestra es insuficiente para generar confianza estadística en la baja tasa de éxito del 33.3% o el ratio de Sharpe de -0.36. La estrategia no filtró adecuadamente los movimientos laterales del contrato de futuros, resultando en pérdidas neta de capital. El siguiente paso crítico es aumentar el volumen de datos simulados al menos a cien operaciones para validar la robustez del algoritmo antes de cualquier despliegue real.

ADDITIONAL METRICS

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