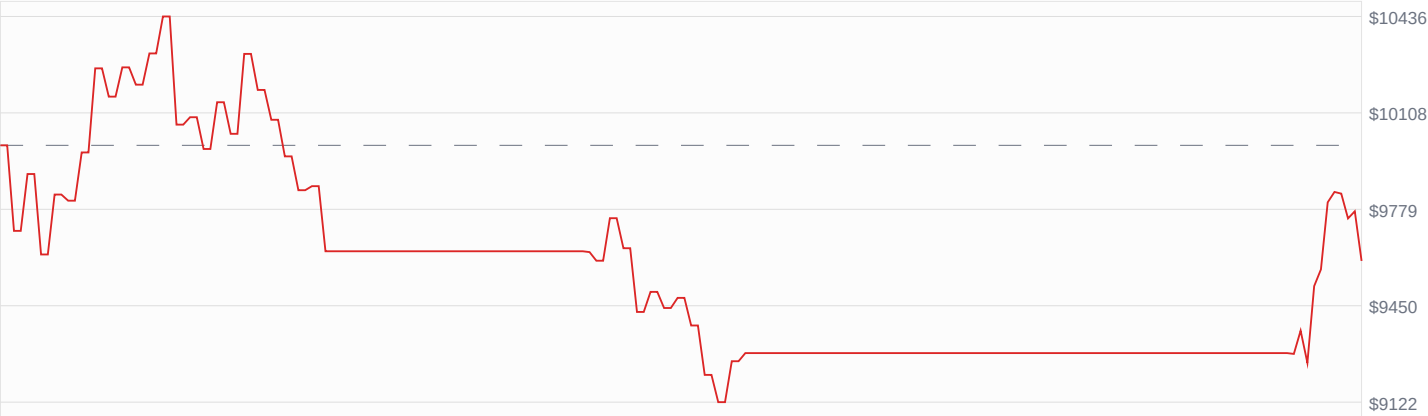




Backtest #51226 · GC=F · EVO_EVOEVOEVOE_v770

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 un ROI negativo del 4.00% y una tasa de victoria del 33.3% tras solo 3 operaciones, lo que genera una confianza estadística insuficiente para inferir la robustez del modelo. La baja relación de Sharpe de -0.36 y el drawdown máximo del 12.60% indican una gestión de riesgo ineficaz en este intervalo de tiempo. Dada la muestra limitada, es prematuro validar la lógica de entrada o salida antes de ajustar los parámetros de filtro. Se requiere ampliar el rango de tiempo de prueba y aumentar el volumen de transacciones históricas para determinar si el comportamiento negativo es una anomalía o una característica sistémica.

ADDITIONAL METRICS

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