



Backtest #51530 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v392

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_v392 en GC=F mostró un resultado negativo con un ROI de -4.00% y un ratio de Sharpe de -0.36, lo que indica una tendencia alcista fallida. Con solo tres operaciones registradas, la muestra es insuficiente para generar confianza estadística sobre la robustez del modelo. El drawdown máximo del 12.60% sugiere que la gestión de riesgo en posiciones perdidas requiere revisión inmediata. Se necesita ampliar el período de backtesting y ajustar los parámetros de entrada para mejorar la tasa de aciertos.

ADDITIONAL METRICS

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