



Backtest #51756 · GC=F · EVO_EVOGG1RSIS_v157

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 muestra una ineficiencia operativa severa, evidenciada por un ROI negativo del 4.00% y un ratio de Sharpe de -0.36. La estrategia generó solo 3 operaciones, lo que es insuficiente para establecer una confianza estadística sobre su robustez o la significancia del drawdown del 12.60%. La baja tasa de ganancia del 33.3% sugiere que los filtros de señal actuales no distinguen adecuadamente el ruido del movimiento direccional en el oro. Es imperativo ejecutar una optimización de parámetros con un periodo de validación más extenso para evaluar si la lógica del sistema es viable bajo condiciones de mercado reales.

ADDITIONAL METRICS

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