



Backtest #52207 · GC=F · EVO_WEBIDEA_v1501

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_WEBIDEA_v1501 presenta un rendimiento negativo del 4.00% con una tasa de éxito del 33.3%, lo que indica una incapacidad estadística significativa para capturar la volatilidad del oro frente al dólar. La baja cantidad de operaciones ejecutadas (solo 3) genera un error de muestreo severo que impide generalizar los resultados a condiciones de mercado futuras. Un drawdown máximo del 12.60% combinado con una relación de Sharpe negativa de -0.36 confirma que el riesgo asumido no ha sido compensado por los retornos observados. La estrategia falla al mantenerse fuera de la tendencia principal durante el periodo evaluado, sugiriendo una necesidad urgente de ajustar los parámetros de entrada para filtrar movimientos

ADDITIONAL METRICS

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