



Backtest #52872 · GC=F · EVO_EVOEVOEVOE_v2079

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 ineficacia operativa severa, con una pérdida neta del 4.0% y una tasa de victoria del 33.3% que indica que la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v2079 pierde más frecuencia de lo que gana. El ratio de Sharpe de -0.36 y un máximo de caída del 12.6% reflejan un perfil de riesgo desalineado con objetivos institucionales, impulsado por solo tres operaciones en la muestra. Esta escasez de datos genera una confianza estadística casi nula, haciendo imposible distinguir entre ruido aleatorio y un fallo estructural del modelo. Se requiere inmediatamente un análisis de supervivencia de señales y una reevaluación de los umbrales de entrada para expandir el tamaño de la muestra 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