



Backtest #41397 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v1570

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+29.90%	1.34	100.0%	-17.75%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de GC=F con EVO_GG1RSISNIP_v1570 muestra un rendimiento atractivo con ROI de +29.90% y Sharpe de 1.34, aunque el win rate del 100% es sospechoso dada la muestra de solo 2 operaciones, lo que limita la confianza estadística. El drawdown máximo del 17.75% indica volatilidad significativa en un solo activo. A pesar de la alta rentabilidad, la falta de diversificación y el tamaño de muestra pequeño sugieren riesgo de overfitting. Se recomienda validar la estrategia con más datos históricos o un portafolio más amplio antes de implementar.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	29.90%
Sortino Ratio	1.03
Turnover	4.30x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$12990.02