



Backtest #43865 · GC=F · EVO_EVOEVOGG1R_v1656

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

La estrategia EVO_EVOEVOGG1R_v1656 sobre GC=F muestra un ROI del 29.90% con una tasa de éxito perfecta, pero el perfil de riesgo es extremadamente sesgado por solo dos operaciones. Un drawdown del 17.75% en tan pocos eventos revela una alta volatilidad que no se mitiga con un Sharpe de 1.34, indicando que la robustez estadística es actualmente nula. Con una muestra tan pequeña, cualquier conclusión sobre la consistencia del modelo carece de validez científica y es vulnerable al overfitting. El siguiente paso crítico es ejecutar un backtest extendido con datos históricos adicionales para validar si la alta rentabilidad se mantiene ante un mayor volumen de operaciones.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	29.90%
Sortino Ratio	1.03
Turnover	4.30x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$12890.02