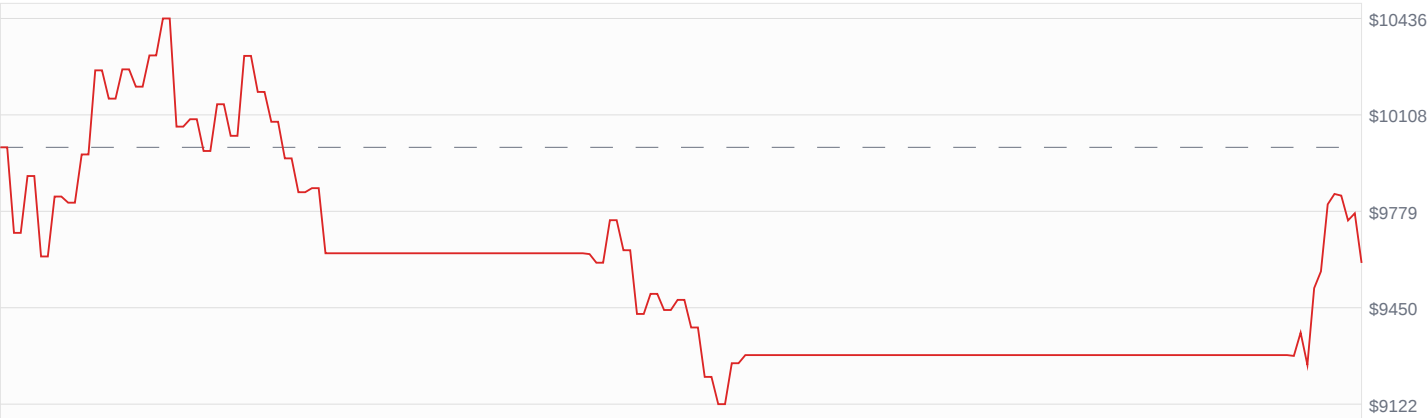




Backtest #47153 · GC=F · EVO\_GG1RSISNIP\_v141

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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

La estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v141 en GC=F resultó ineficaz, generando una pérdida del 4% y un ratio Sharpe negativo debido a una tasa de ganancia del 33.3% sobre solo 3 operaciones. Este bajo volumen de datos carece de poder estadístico para validar la robustez del modelo, por lo que los resultados actuales carecen de confiabilidad predictiva. La pérdida máxima del 12.6% indica que el riesgo no está adecuadamente gestionado frente a la frecuencia de entrada. Se requiere recopilar más datos históricos para ajustar los parámetros de entrada y eliminar las señales falsas que provocaron la pérdida de capital.

ADDITIONAL METRICS

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