



Backtest #49502 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v399

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 ineficiencia crítica con una tasa de ganancia del 33.3% y un drawdown máximo del 12.60% sobre solo tres operaciones. La métrica de Sharpe negativa de -0.36 indica que las pérdidas superaron a las ganancias, lo cual no es estadísticamente significativo debido a la muestra insuficiente. La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v399 requiere más datos para validar su lógica, ya que el bajo volumen de trades no permite descartar un evento de cola. El siguiente paso es ajustar los parámetros de entrada en el backtest para generar una muestra mínima de 50 operaciones 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