



Backtest #51719 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v95

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 en GC=F muestra una ineficiencia operativa severa, con una tasa de éxito del 33.3% y un drawdown máximo del 12.60% que invalida la robustez del modelo EVO_GG1RSISNIP_v95. La pérdida del 4.00% sobre un universo de solo tres operaciones revela una falta de significancia estadística crítica, imposibilitando distinguir el ruido del señal real. La baja Sharpe de -0.36 confirma que el costo de transacción y la volatilidad reciente de los futuros de oro han erosionado cualquier ventaja alfa potencial. Ante esta muestra insuficiente, el siguiente paso estricto es ejecutar una validación out-of-sample en un periodo de expansión lateral para filtrar las condiciones de mercado que disparan las pérdidas.

ADDITIONAL METRICS

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