



Backtest #51841 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v1479

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 con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1479 muestra una pérdida del 4% con un ratio Sharpe negativo, evidenciando una incapacidad para capturar tendencias en esta muestra. La tasa de aciertos del 33.3% y un máximo de caída del 12.60% sugieren que las señales generadas carecen de robustez estadística ante el ruido del mercado. Con solo tres operaciones registradas, el resultado carece de confiabilidad significativa y no permite distinguir entre mala suerte y defectos de diseño. La siguiente prioridad es ampliar el periodo de validación para incrementar el número de operaciones y obtener una distribución muestral representativa. Este análisis es meramente informativo y no constituye asesoramiento financiero.

ADDITIONAL METRICS

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