



Backtest #51914 · GC=F · EVO_EVOEVOEVOE_v704

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_EVOEVOEVOE_v704 muestra una ineficiencia operativa clara, con un ROI negativo del 4% y un ratio de Sharpe de -0.36. La baja tasa de aciertos del 33.3% combinada con un máximo de pérdidas del 12.6% indica que el sistema pierde más capital de lo que gana en sus tres operaciones. La estadística carece de robustez debido a la muestra diminuta de solo tres operaciones, lo que impide distinguir entre ruido aleatorio y una falla estructural en la lógica de entrada. Se requiere un análisis detallado de los niveles de soporte y resistencia en el gráfico de 2026-09-01 para ajustar los filtros de confirmación y reducir la exposición a falsas señales. El siguiente paso es re-ejecutar el backtest con al menos 100

ADDITIONAL METRICS

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