



Backtest #54006 · GC=F · EVO_EVOVELOCIT_v1527

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_EVOVELOCIT_v1527 en GC=F falló estrepitosamente, generando una pérdida del 4% con un ratio de Sharpe negativo de -0.36 y una tasa de aciertos de solo 33.3%. Los tres operaciones fueron insuficientes para generar confianza estadística, lo que sugiere que los resultados pueden ser ruido aleatorio más que una debilidad sistémica del algoritmo. El drawdown máximo del 12.6% indica una exposición al riesgo desproporcionada durante los intentos de entrada. Se recomienda ampliar el conjunto de datos de backtesting para identificar patrones de fallo consistentes antes de desplegar capital real.

ADDITIONAL METRICS

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