



Backtest #55889 · GC=F · EVO_EVOEVOEVOE_v2351

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 para la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v2351 muestra una pérdida neta del 4.00% y un ratio de Sharpe negativo, indicando un desempeño ineficiente bajo las condiciones probadas. La tasa de éxito del 33.3% combinada con tres operaciones totales revela una muestra estadísticamente insuficiente para validar la robustez o el riesgo real del modelo. La caída máxima del 12.60% sugiere una exposición significativa que no se ha mitigado adecuadamente en esta configuración. Dada la falta de datos históricos suficientes para confirmar tendencias, es imperativo ejecutar una prueba de estrés en mercados de alta volatilidad antes de cualquier despliegue.

ADDITIONAL METRICS

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