



Backtest #57120 · GC=F · EVO_GG1RSISNIP_v264

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 EVO_GG1RSISNIP_v264 en el contrato de oro GC=F muestra una pérdida del 4% con una tasa de éxito del 33.3% en tan solo tres operaciones, lo que indica una falta de robustez estadística significativa. La razón de Sharpe negativa de -0.36 y una caída máxima del 12.6% sugieren que la estrategia sufre de sobreajuste a ruido o condiciones de mercado específicas de ese periodo limitado. Con una muestra tan pequeña, cualquier conclusión sobre el rendimiento futuro carece de validez confiable y aumenta el riesgo de falsos positivos. Es necesario re-ejecutar la prueba con más datos o ajustar los parámetros de entrada para filtrar mejor la volatilidad del commodity.

ADDITIONAL METRICS

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