



Backtest #2295 · MSFT · EVO\_GG1RSISNIP\_v1632

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -13.10% | -1.37  | 0.0%     | -17.07%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de MSFT con la estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v1632 es un fracaso estructural: con un ROI de -13.10%, un Sharpe de -1.37 y una tasa de aciertos del 0%, no generó ni un solo trade ganador. La muestra de 3 operaciones es estadísticamente irrelevante, pero la magnitud de la pérdida y el drawdown del 17.07% confirman que la lógica de entrada está rota para este activo. La estrategia no filtró correctamente el ruido de MSFT, generando entradas tardías o contrarias a la tendencia. El siguiente paso obligatorio es auditar el signal\_manifest para identificar por qué no hubo aciertos y descartar esta versión hasta revalidar los parámetros de entrada. ¡Ojo! Esto no es consejo de inversión, solo análisis cuantitativo.

ADDITIONAL METRICS

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| CAGR            | -13.10%   |
| Sortino Ratio   | -0.80     |
| Turnover        | 5.63x     |
| Total Trades    | 3         |
| Initial Capital | \$9997.00 |
| Final Capital   | \$8692.42 |