



Backtest #27281 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v146

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

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v146 en MSFT destruyó capital (-13.10% ROI) con un Sharpe de -1.37, indicando riesgo no compensado. El 0% de aciertos en solo 3 operaciones confirma que el resultado es estadísticamente insignificante y no generalizable. La caída máxima del 17% en tres intentos sugiere fallos estructurales en la lógica de entrada o gestión de riesgo. Se requiere optimización urgente de los parámetros de señal y aumento del universo de prueba para validar cualquier ajuste. Esto no es trading, es quema de capital.

ADDITIONAL METRICS

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