



Backtest #28948 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v1200

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-15.97%	-1.25	33.3%	-19.93%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1200 presentó un rendimiento negativo con un ROI de -15.97% y Sharpe ratio de -1.25, indicando una falta de capacidad de generación de alpha. El bajo win rate del 33.3% y un drawdown máximo del 19.93% sugieren una falta de robustez en su señal. Con tan solo 3 operaciones, el tamaño de muestra es insuficiente para afirmar una confianza estadística. Se recomienda aumentar la muestra de datos y ajustar parámetros del modelo para mejorar la estabilidad del sistema.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-15.97%
Sortino Ratio	-0.75
Turnover	5.36x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8405.37