



Backtest #30692 · MSFT · Astute AST Engine Bot

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-17.07%	-1.36	33.3%	-19.93%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia Astute para MSFT mostró un rendimiento negativo con una ROI de -17.07% y Sharpe ratio de -1.36, indicando que los retornos no compensaron el riesgo asumido. La baja tasa de ganancia del 33.3% sugiere que el modelo de señalización necesita ajustes. Con tan pocas operaciones (3 trades), la muestra carece de poder estadístico para confianza sólida. Se recomienda aumentar el número de trades a al menos 50 para validar la estrategia.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-17.07%
Sortino Ratio	-0.82
Turnover	5.30x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8295.86