



Backtest #31443 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v222

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 EVO_GG1RSISNIP_v222 presentó resultados negativos en la prueba de retroceso de MSFT, con una rentabilidad de -17.07% y una ratio de Sharpe de -1.36, indicando una falta de eficiencia en la gestión del riesgo. La baja tasa de ganancia del 33.3% y la baja capitalización final sugieren que el modelo no está bien optimizado para este activo. Con tan solo 3 operaciones, la muestra es demasiado pequeña para confiar en los resultados estadísticamente significativos. El próximo paso debería ser reajustar los parámetros del modelo para mejorar la precisión de las señales de entrada y salida.

ADDITIONAL METRICS

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