



Backtest #31445 · 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 un rendimiento negativo en la prueba de retroceso de MSFT con una ROI de -17.07%, Sharpe ratio de -1.36 y una tasa de ganancia del 33.3%. La muestra de solo 3 operaciones limita la confianza estadística, indicando una alta volatilidad y riesgo de sobreajuste. El máximo retroceso del 19.93% revela una exposición significativa al riesgo de capital. Se recomienda implementar una prueba de retroceso con un mínimo de 50 operaciones para mejorar la validación estadística del modelo antes de considerar su implementación en producción.

ADDITIONAL METRICS

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