



Backtest #31500 · MSFT · EVO\_GG1RSISNIP\_v285

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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\_v285 presentó un rendimiento negativo en la backtest de MSFT con un ROI de -17.07%, Sharpe ratio negativo de -1.36 y una tasa de ganancia del 33.3%. Con solo 3 operaciones, la muestra es muy pequeña para validar la confiabilidad estadística del modelo. El drawdown máximo de 19.93% indica altos riesgos en condiciones de mercado extremo. La estrategia necesita ser reentrenada con más datos y parámetros ajustados para mejorar su capacidad de adaptación y reducir el riesgo de sobreajuste. El siguiente paso es ejecutar un backtest más amplio con al menos 50 operaciones para validar la robustez del modelo antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

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