



Backtest #31700 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v116

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_v116 presentó un rendimiento negativo en la prueba de retroceso para MSFT con una ROI de -17.07% y una ratio Sharpe de -1.36, indicando una mala gestión del riesgo. Aunque el porcentaje de trades ganadores fue del 33.3%, este número es insuficiente para justificar la estrategia, especialmente con solo 3 operaciones que limitan la confianza estadística. El máximo drawdown del 19.93% evidencia una alta volatilidad sin control adecuado. Se recomienda ajustar los parámetros de entrada de la estrategia para mejorar la selección de señales antes de futuras pruebas.

ADDITIONAL METRICS

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