



Backtest #33249 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v467

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-18.16%	-1.47	0.0%	-18.90%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v467 en MSFT mostró una ROI de -18.16% con 3 operaciones, todas pérdidas (0% de ganancia), y un Sharpe negativo (-1.47), indicando alta volatilidad sin recompensa. El drawdown máximo del 18.90% sugiere exposición excesiva en una muestra muy pequeña (3 trades), limitando la confiabilidad estadística. La falta de ganancias y la baja diversificación de activos son puntos críticos. Next step: expandir la muestra a al menos 50 trades para validar la robustez

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-18.16%
Sortino Ratio	-0.87
Turnover	5.32x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8186.79