



Backtest #36264 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v47

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-15.43%	-1.22	33.3%	-18.90%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v47 en MSFT falló estrepitosamente, registrando una pérdida del 15.43% con un ratio de Sharpe negativo de -1.22. Solo tres operaciones conforman la muestra, lo que hace que los resultados carezcan de cualquier confianza estadística significativa. La baja tasa de aciertos del 33.3% y un máximo de caída del 18.90% revelan una lógica de entrada ineficiente o mal calibrada. Se requiere ampliar el conjunto de datos para validar cualquier patrón antes de ajustar los parámetros. El siguiente paso obvio es reestructurar los criterios de entrada o eliminar la estrategia temporalmente.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-15.43%
Sortino Ratio	-0.71
Turnover	5.43x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8459.16