



Backtest #36520 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v466

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-14.20%	-1.11	33.3%	-18.90%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de MSFT para EVO_GG1RSISNIP_v466 muestra una ineficiencia operativa crítica con solo tres operaciones, lo que invalida cualquier conclusión estadística sobre la robustez de la estrategia. La combinación de un retorno negativo del 14.2% y una tasa de aciertos del 33.3% sugiere que los parámetros actuales de entrada y salida están mal calibrados para las condiciones de mercado actuales. Un drawdown del 18.9% indica una falta de protección adecuada en los stops o una exposición excesiva a movimientos adversos no gestionados. La baja muestra de operaciones impide calcular una distribución de riesgos fiable, haciendo que la métrica de Sharpe negativa sea un indicador de ineficiencia más que de tendencia. El siguiente paso

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-14.20%
Sortino Ratio	-0.64
Turnover	5.49x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8582.35