



Backtest #9266 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v1578

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-13.10%	-1.37	0.0%	-17.07%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de MSFT con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1578 muestra un rendimiento extremadamente negativo. ROI: -13.10%, Sharpe ratio: -1.37, Win rate: 0.0%, Max Drawdown: 17.07%, y solo 3 trades ejecutados. Esto indica que la estrategia no generó ninguna operación ganadora en la muestra analizada, lo que sugiere un fallo crítico en la lógica de entrada, gestión de riesgo, o ambos. Con solo 3 trades, la muestra estadística es insuficiente para generalizar, aunque el drawdown máximo del 17% y el Sharpe negativo ya son señales de alarma. Se recomienda reevaluar los parámetros de entrada y filtro de señal antes de considerar cualquier despliegue en vivo.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-13.10%
Sortino Ratio	-0.80
Turnover	5.63x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8692.42