



Backtest #40989 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v1549

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-9.66%	-0.71	33.3%	-18.90%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de MSFT con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1549 presenta una pérdida de -9.66% y una tasa de éxito del 33.3% en solo tres operaciones, lo que indica una señalización ineficaz y un riesgo desproporcionado. La relación de Sharpe negativa de -0.71 confirma un desempeño inferior al de mantener el capital, mientras que una caída máxima del 18.90% revela una falta de gestión de riesgo adecuada en el diseño del algoritmo. La estadística de muestra es insuficiente para establecer confianza, ya que tres operaciones no permiten distinguir entre ruido de mercado y una falla estructural del modelo. Es imperativo aumentar el tamaño de la muestra mediante un testeo extendido y ajustar los parámetros de entrada y salida para reducir la sensibilidad del

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-9.66%
Sortino Ratio	-0.40
Turnover	5.54x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9036.55