



Backtest #30454 · MSFT · EVO_EVOGG1RSIS_v427

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-17.07%	-1.36	33.3%	-19.93%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_EVOGG1RSIS_v427 mostró un rendimiento negativo en MSFT con ROI de -17.07%, Sharpe de -1.36 y win rate de 33.3%, lo cual indica una falta de capacidad predictiva con solo 3 operaciones, un tamaño de muestra muy limitado para confianza estadística. La alta pérdida máxima de 19.93% sugiere riesgos de capital no gestionados adecuadamente. Se recomienda aumentar el número de operaciones a al menos 50 para validar estadísticamente el modelo antes de considerar una mejora.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-17.07%
Sortino Ratio	-0.82
Turnover	5.30x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8295.86