



Backtest #30795 · MSFT · EVO_WEBIDEA_v63

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_WEBIDEA_v63 presentó un rendimiento negativo en backtest con MSFT, generando una ROI de -17.07% y Sharpe ratio de -1.36, indicando que el riesgo superó los retornos. El win rate del 33.3% y la baja cantidad de trades (3) sugieren baja confiabilidad estadística, no permitiendo conclusiones sólidas. La alta drawdown máxima de 19.93% revela una gestión de riesgos deficiente. Se recomienda aumentar la muestra de trades a al menos 30 para mejorar la validez del análisis.

ADDITIONAL METRICS

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