



Backtest #31016 · MSFT · EVO_WEBIDEA_v175

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_v175 presentó un rendimiento negativo en MSFT con un ROI de -17.07%, Sharpe ratio negativo de -1.36 y una tasa de ganancia del 33.3%, lo cual indica una falta de consistencia. Con solo 3 operaciones, la muestra es muy pequeña para validar su capacidad de generación de alpha. El drawdown máximo fue del 19.93%, lo que sugiere alta volatilidad sin control adecuado. Se recomienda aumentar el número de trades a al menos 30 para mejorar la confianza estadística y evaluar si se requiere ajuste del filtro de entrada.

ADDITIONAL METRICS

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