



Backtest #31017 · 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 con una pérdida neta del 17.07%, lo que indica una falta de capacidad de generación de alpha en el periodo analizado. El Sharpe negativo de -1.36 sugiere un mal ajuste entre riesgo y retorno. La baja tasa de ganancia del 33.3% junto con solo 3 operaciones limitan la confianza estadística sobre sus resultados. Se requiere una optimización de parámetros antes de reintentar con mayor rigor. El análisis reveló que el modelo necesita un ajuste de señales para mejorar su capacidad de identificación de tendencias.

ADDITIONAL METRICS

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