



Backtest #31794 · MSFT · EVO_EVOEVOEVOE_v767

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_EVOEVOEVOE_v767 presenta un rendimiento negativo del 17.07% con una baja tasa de ganancia del 33.3%, indicando que el modelo no captura adecuadamente la dirección del mercado en MSFT. El Sharpe ratio negativo (-1.36) sugiere que el riesgo no está compensado por el retorno, y el drawdown máximo del 19.93% refleja una exposición significativa al riesgo. Con solo 3 operaciones, la muestra es muy limitada para afirmar confianza estadística. Se recomienda revisar los parámetros de entrada del modelo para ajustar el filtro de entrada y evitar señales erróneas en entornos de alta volatilidad.

ADDITIONAL METRICS

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