



Backtest #33316 · MSFT · EVO_EVOEVOEVOG_v476

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-18.16%	-1.47	0.0%	-18.90%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de EVO_EVOEVOEVOG_v476 en MSFT muestra un ROI negativo del -18.16% con un Sharpe ratio de -1.47, indicando una falta de rentabilidad y riesgo elevado. Todos los 3 trades fueron pérdidas (win rate 0%), y el max drawdown alcanzó el 18.90%, sugiriendo una falta de gestión de riesgo. La pequeña muestra (3 trades) limita la confianza estadística en los resultados. Next step: expandir la muestra para validar la estrategia en condiciones más robustas.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-18.16%
Sortino Ratio	-0.87
Turnover	5.32x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$8186.79