



Backtest #34203 · MSFT · EVO_EVOEVOE_v751

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_EVOEVOE_v751 en MSFT muestra una ROI negativa del -18.16% con una tasa de ganancia del 0%, lo que sugiere una estrategia sin capacidad de selección. La baja muestra de solo 3 operaciones limita la confiabilidad estadística, y el ratio Sharpe (-1.47) refleja un riesgo desproporcionado. La caída máxima del 18.90% indica volatilidad alta en un contexto de rendimiento negativo. Se necesita un mayor volumen de datos para validar la estrategia antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

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