



Backtest #37720 · MSFT · EVO_EVOEVOE_v779

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-9.23%	-0.67	33.3%	-18.90%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de MSFT con la estrategia EVO_EVOEVOE_v779 muestra un rendimiento negativo del 9.23% y una pérdida de capital que reduce la cuenta final a 9080 dólares. La baja tasa de éxito del 33.3% combinada con un ratio de Sharpe de -0.67 indica que el enfoque de señalización está generando más pérdidas que ganancias en este contexto. Con solo tres operaciones, los resultados carecen de significancia estadística suficiente para validar o refutar la lógica subyacente de la estrategia. El drawdown máximo del 18.90% sugiere una exposición al riesgo inaceptable incluso en una muestra tan pequeña. Lo siguiente es ampliar el periodo de prueba o ajustar los parámetros de entrada para generar un volumen de datos mayor antes de considerar ajustes

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-9.23%
Sortino Ratio	-0.38
Turnover	5.55x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9080.00