



Backtest #44058 · MSFT · EVO_EVOEVOE_v1930

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-9.66%	-0.71	33.3%	-18.90%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOE_v1930 presentó resultados negativos en MSFT con un ROI de -9.66% y una relación Sharpe de -0.71, indicando que el riesgo no fue compensado por los retornos. Solo 3 operaciones fueron ejecutadas, lo cual limita la confianza estadística sobre su rendimiento. El win rate del 33.3% sugiere una falta de consistencia en la selección de señales, mientras que un drawdown máximo del 18.90% revela altas volatilidades. Se recomienda aumentar el número de trades a al menos 20 para validar la estrategia antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-9.66%
Sortino Ratio	-0.40
Turnover	5.54x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9036.55