



Backtest #46133 · MSFT · EVO_EVOVELOCIT_v1506

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

El backtest para MSFT con EVO_EVOVELOCIT_v1506 muestra una pérdida del 9.66% y un ratio Sharpe negativo de -0.71, indicando que la estrategia no superó el riesgo de mercado. Solo tres operaciones registradas generan una tasa de ganancia del 33.3% y una caída máxima del 18.90%, lo que carece de la robustitud estadística para validar el modelo. La baja frecuencia de operaciones sugiere que los filtros de entrada son demasiado restrictivos o que el parámetro de velocidad está mal calibrado para esta acción. Ante la falta de datos significativos, es necesario ajustar los umbrales de señal o ampliar el periodo de prueba para descartar un resultado por muestreo insuficiente. Cualquier despliegue de capital real requiere primero una

ADDITIONAL METRICS

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