



Backtest #47432 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v1476

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+23.06%	1.19	50.0%	-14.24%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de EVO_GG1RSISNIP_v1476 en MSFT muestra un ROI del 23.06% con un ratio de Sharpe de 1.19, pero la viabilidad estadística es nula dado el reducido volumen de solo dos operaciones. Una tasa de éxito del 50% y una caída máxima del 14.24% indican alta volatilidad sin suficiente historial para validar la robustez del modelo ante condiciones de mercado cambiantes. La estrategia necesita más iteraciones y datos para confirmar su consistencia antes de considerar su despliegue en capital real. El siguiente paso obligatorio es ejecutar una prueba con un conjunto de datos extendido para evaluar la estabilidad del ratio de Sharpe y la frecuencia de trades.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	23.06%
Sortino Ratio	1.09
Turnover	4.08x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$12310.11