



Backtest #49779 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v1197

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 MSFT con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1197 muestra un ROI del 23.06% y un ratio de Sharpe de 1.19, lo cual indica rentabilidad ajustada al riesgo, pero solo dos operaciones son insuficientes para validar la robustez estadística del modelo. La tasa de aciertos del 50% y una caída máxima del 14.24% sugieren que el sistema es altamente sensible a la selección de entradas, ya que un resultado positivo en tan pocos intentos carece de confiabilidad operativa real. Sin una muestra histórica más amplia, es premisa asumir que esta configuración funcionará de manera consistente en condiciones de mercado futuras. El siguiente paso crítico es ampliar el intervalo de prueba y ejecutar una prueba de estrés en diferentes regímenes de volatilidad antes

ADDITIONAL METRICS

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