



Backtest #51326 · MSFT · EVO_EVOEVOEVOE_v836

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+21.45%	1.12	50.0%	-14.24%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de MSFT con la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v836 muestra una rentabilidad del 21.45%, pero la muestra de solo dos operaciones es estadísticamente insignificante para validar la robustez del modelo. Aunque el ratio de Sharpe de 1.12 indica un rendimiento ajustado al riesgo positivo, la tasa de acierto del 50% y el máximo retroceso del 14.24% reflejan una alta volatilidad inherente al pequeño volumen de datos. No se puede inferir confianza en la estrategia sin ampliar el periodo de prueba para reducir la varianza y confirmar la consistencia de los resultados. El paso inmediato es ejecutar un re-backtest con un conjunto de datos más amplio o ajustar los parámetros para generar un historial de operaciones más sustancial.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	21.45%
Sortino Ratio	1.03
Turnover	4.06x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$12149.06