



Backtest #56420 · MSFT · EVO\_GG1RSISNIP\_v279

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +20.07% | 1.06   | 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\_v279 muestra una ganancia bruta del 20.07%, pero los solo dos ejecutados limitan severamente la confianza estadística sobre esa métrica. Un drawdown máximo del 14.24% indica una volatilidad considerable que no se mitigó con una tasa de aciertos del 50%, sugiriendo que el éxito fue más suerte que consistencia. La ratio de Sharpe de 1.06 es aceptable en teoría, pero insuficiente para validar la robustez de la señal sin un historial más largo. La escasez de datos impide distinguir entre ruido del mercado y una ventaja real del modelo. El siguiente paso crítico es ampliar el rango de datos de prueba y ajustar los parámetros de entrada para reducir la exposición a eventos de baja probabilidad.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 20.07%     |
| Sortino Ratio   | 0.98       |
| Turnover        | 4.05x      |
| Total Trades    | 2          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$12011.02 |