



Backtest #46714 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v44

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 EVO_GG1RSISNIP_v44 muestra una rentabilidad del 23.06% y un Sharpe de 1.19, pero la muestra de solo dos operaciones es estadísticamente insuficiente para validar la robustez de la estrategia. La tasa de acierto del 50% y el máximo retroceso del 14.24% indican que el riesgo de sobreajuste a condiciones de mercado específicas es alto sin más datos. A pesar de la ganancia neta, la falta de profundidad muestral impide concluir si el sistema es rentable en diferentes escenarios de volatilidad. Se recomienda ejecutar una prueba de estresamiento con datos fuera de muestra para evaluar la capacidad de adaptación del modelo antes de cualquier despliegue real.

ADDITIONAL METRICS

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