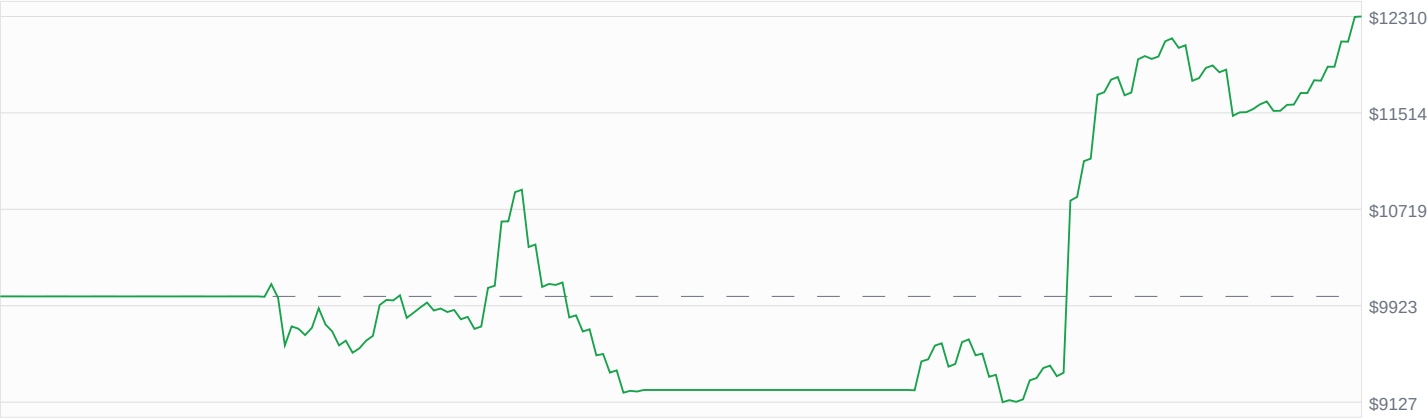


Backtest #47234 · MSFT · EVO\_EVOEVOEVOE\_v836

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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 muestra un ROI del 23.06% y un ratio de Sharpe de 1.19, pero los resultados carecen de validez estadística al depender de solo dos operaciones. La tasa de ganancia del 50% y una máxima caída del 14.24% indican una alta volatilidad sin la confirmación necesaria de un conjunto de datos robusto. Esta estrategia no ha demostrado consistencia suficiente para ser considerada confiable en condiciones de mercado reales. La siguiente acción prioritaria es ejecutar pruebas de estrés con mayor frecuencia de operaciones para validar la robustez del modelo antes de cualquier despliegue.

ADDITIONAL METRICS

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