



Backtest #47509 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v915

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 una ganancia bruta del 23.06% con un ratio de Sharpe de 1.19, pero la solidez estadística es inexistente al haber generado solo dos operaciones. Una tasa de acierto del 50% combinada con un máximo drawdown del 14.24% indica alta volatilidad y falta de consistencia en la lógica del filtro. Sin un volumen de datos suficiente, estos resultados carecen de valor predictivo real y son propensos a sobreajuste en condiciones de mercado específicas. La estrategia requiere una reconfiguración agresiva de los umbrales de entrada o un cambio de parámetro para aumentar el número de señales. El siguiente paso crítico es ejecutar una nueva simulación con datos extendidos y ajustar los filtros de RSI para mejorar la

ADDITIONAL METRICS

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