



Backtest #48543 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v1635

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

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1635 generó un ROI del 23.06% en Microsoft, pero el bajo número de operaciones y la alta volatilidad relativa del activo limitan severamente la confianza estadística de estos resultados. Aunque la relación de Sharpe de 1.19 indica un riesgo razonable por retorno, una tasa de éxito del 50% y un máximo de caída del 14.24% sugieren que el modelo carece de consistencia en la captura de tendencias sostenibles. Con solo dos operaciones registradas, es imposible validar la robustez de la lógica subyacente ante cambios en los regímenes de mercado. Se requiere aumentar el tamaño del conjunto de datos mediante pruebas en periodos más largos o en activos con mayor volumen para confirmar la viabilidad operativa.

ADDITIONAL METRICS

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