



Backtest #56441 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v420

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_v420 generó un ROI del 20.07% con un ratio de Sharpe moderado del 1.06, pero los resultados carecen de robustez estadística debido a un volumen crítico de solo dos operaciones. La tasa de acierto del 50% y una máxima caída del 14.24% sugieren alta sensibilidad a condiciones de mercado específicas en lugar de una ventaja persistente. La muestra insuficiente impide validar la consistencia del modelo ante la variabilidad inherente del precio de Microsoft. Se requiere ampliar el periodo de prueba para filtrar ruido estocástico y confirmar si la señal de entrada es replicable.

ADDITIONAL METRICS

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