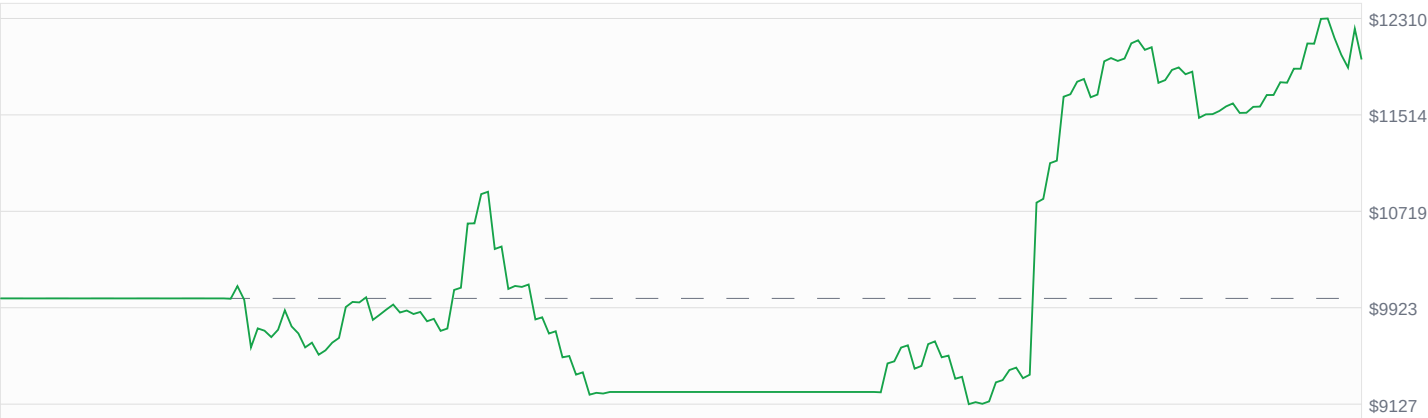




Backtest #57450 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v348

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+19.68%	1.03	50.0%	-14.24%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de MSFT muestra una rentabilidad bruta del 19.68% impulsada por un único movimiento a favor, pero la baja frecuencia de solo dos operaciones invalida cualquier conclusión estadística robusta sobre la estrategia. Un ratio de Sharpe de 1.03 parece sólido en el papel, aunque es altamente susceptible a la sobreoptimización por la falta de diversidad en el historial de pérdidas y ganancias. La profundidad del máximo retroceso del 14.24% indica una alta volatilidad de capital que no se mitiga con un tamaño de muestra tan limitado. Dado que el resultado depende de un evento aislado, la estrategia requiere validación en periodos de mercado laterales y de tendencia para confirmar su resiliencia. La siguiente acción crítica es ejecutar

ADDITIONAL METRICS

CAGR	19.68%
Sortino Ratio	0.97
Turnover	4.04x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$11971.60