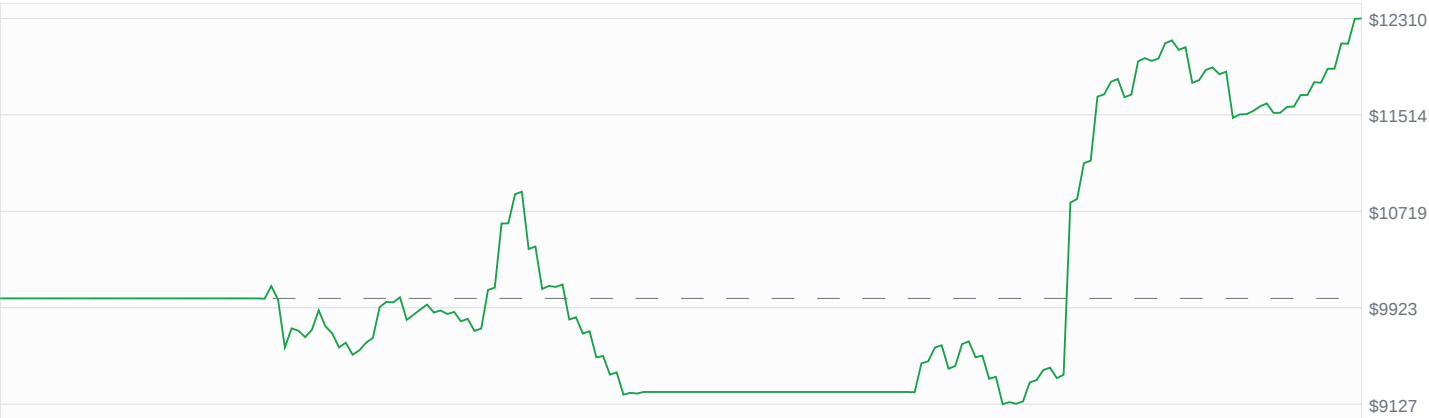




Backtest #46713 · MSFT · EVO_GG1RSISNIP_v44

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_v44 sobre MSFT generó un ROI del 23.06%, pero un total de solo dos operaciones invalida cualquier conclusión estadística robusta. Aunque la relación riesgo-recompensa (Sharpe de 1.19) y la rentabilidad neta parecen sólidas, la extrema falta de muestras impide evaluar la consistencia del sistema frente a volatilidades distintas a las pruebas iniciales. El drawdown del 14.24% es aceptable, pero sin historial suficiente para calcular un intervalo de confianza, el riesgo de sobreajuste es alto. Se requiere ampliar el periodo de backtesting con datos históricos más extensos para validar la robustez antes de desplegar capital real.

ADDITIONAL METRICS

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