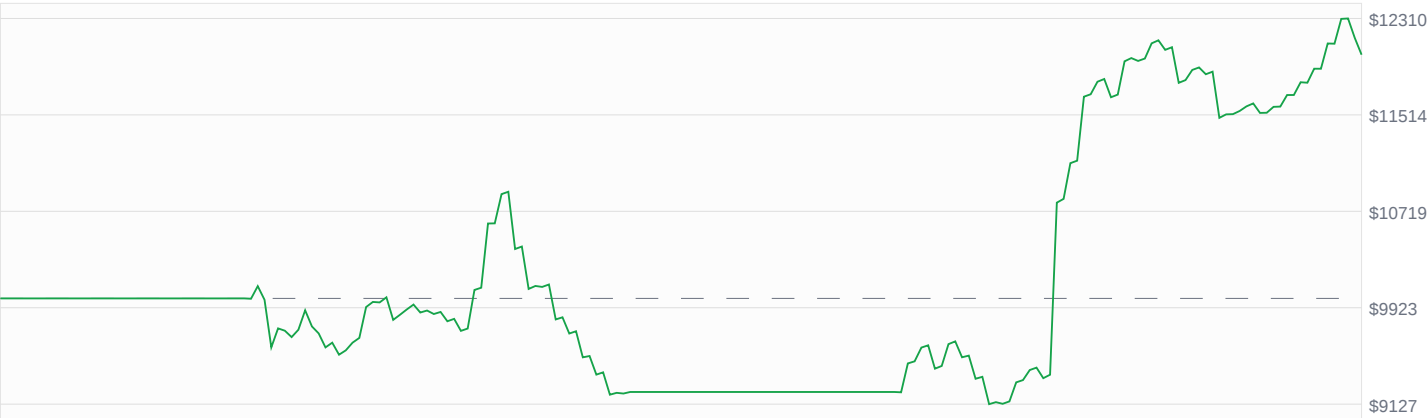




Backtest #55759 · MSFT · EVO_EVOEVOEVOE_v2248

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 para la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v2248 muestra un ROI del 20.07% y una ratio Sharpe de 1.06, pero solo dos operaciones invalidan cualquier conclusión estadística sólida. Una tasa de éxito del 50% con un máximo de caída del 14.24% indica que la rentabilidad actual depende totalmente de la suerte en lugar de la consistencia del modelo. La falta de volumen muestral hace imposible distinguir entre una señal genuina y un resultado aleatorio en este periodo corto. Para validar la estrategia es imperativo ejecutar un backtest con al menos mil operaciones o ajustar los parámetros para aumentar la frecuencia de señales.

ADDITIONAL METRICS

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