



Backtest #56625 · MSFT · EVO\_GG1RSISNIP\_v357

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +20.07% | 1.06   | 50.0%    | -14.24%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTEHera local LLM

El backtest de EVO\_GG1RSISNIP\_v357 en MSFT muestra un ROI positivo del 20.07% con una tasa de ganancia del 50.0%, pero solo dos operaciones generan resultados estadísticamente no confiables. La alta volatilidad de un 14.24% en drawdown máximo y una relación Sharpe de 1.06 sugieren que el riesgo no está ajustado adecuadamente a la pequeña muestra. Aunque el capital final de 12011.02 dólares indica rentabilidad, la escasez de datos impide validar la robustez de la estrategia ante diferentes condiciones de mercado. Se requiere ampliar el periodo histórico o ajustar los parámetros para obtener un conjunto de datos lo suficientemente grande para confirmar la consistencia del rendimiento antes de cualquier implementación real.

ADDITIONAL METRICS

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