



Backtest #1546 · GOOGL · EVO_EVOEVOEVOE_v603

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+3.41%	0.33	50.0%	-11.43%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La muestra es estadísticamente inválida con solo 2 trades, lo que hace que el ROI del +3.41% y el Sharpe de 0.33 carezcan de relevancia predictiva. La drawdown del -11.43% es desproporcionada para tan pocos movimientos, revelando un riesgo de cola no diversificado. Sin embargo, un win rate del 50% sugiere que la lógica de entrada no es inherentemente sesgada, aunque la muestra es insuficiente para confirmarlo. Se requiere ejecutar walk-forward con al menos 100 trades para validar la robustez del modelo. Próximos pasos: optimizar parámetros y expandir el dataset de prueba antes de cualquier consideración live.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	3.41%
Sortino Ratio	0.34
Turnover	3.88x
Total Trades	2
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10341.17