



Backtest #29233 · GOOGL · EVO\_GG1RSISNIP\_v190

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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

El backtest de GOOGL con la estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v190 muestra un ROI de +3.41% con un Sharpe de 0.33, pero con solo 2 operaciones, lo cual limita la confianza estadística. La tasa de ganancia del 50% sugiere un diseño inestable. El máximo drawdown del 11.43% revela riesgos de capital. Para avanzar, se recomienda realizar un backtest adicional con al menos 50 trades para validar la robustez del modelo y su capacidad de generar alpha sistemáticamente.

ADDITIONAL METRICS

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