



Backtest #30696 · GOOGL · Zen Mean Reversion

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 Zen Mean Reversion muestra un ROI positivo de +3.41%, pero con una muestra extremadamente limitada de solo 2 trades, lo que reduce la confianza estadística. El Sharpe ratio de 0.33 sugiere un rendimiento débil en relación con el riesgo, y el win rate del 50% indica una falta de edge. Dado el bajo volumen de operaciones, lo recomendable es aumentar la muestra de datos para validar si el comportamiento se repite o es un caso aislado. La estrategia requiere más robustez antes de considerarla para producción.

ADDITIONAL METRICS

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