



Backtest #30735 · GOOGL · EVO\_GG1RSISNIP\_v21

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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 EVO\_GG1RSISNIP\_v21 en GOOGL muestra un rendimiento modesto con ROI de +3.41% y Sharpe de 0.33, indicando baja sensibilidad a riesgos. A pesar de una tasa de ganancia del 50%, el número limitado de 2 operaciones reduce la confianza estadística. El drawdown máximo de 11.43% sugiere volatilidad significativa en escenarios de mercado. Se recomienda aumentar el volumen de backtests a al menos 50 operaciones para validar la estrategia antes de considerar su implementación en producción.

ADDITIONAL METRICS

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