



Backtest #50991 · GOOGL · EVO_EVOEVOEVOG_v477

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+6.75%	0.54	33.3%	-15.79%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de GOOGL muestra un ROI del 6.75% con un ratio de Sharpe bajo de 0.54 y una tasa de acierto del 33.3%, lo que indica una estrategia de tendencia muy ruidosa. La profundidad de la prueba con solo tres operaciones es insuficiente para validar la robustez de la estrategia ante diferentes regímenes de mercado. El alto riesgo potencial, evidenciado por un máximo de pérdida del 15.79%, sugiere una exposición excesiva a eventos específicos en lugar de un factor estadístico consistente. Se requiere ampliar el periodo de simulación con más datos para estimar con confianza los parámetros de riesgo y mejorar la consistencia de los resultados.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	6.75%
Sortino Ratio	0.48
Turnover	6.53x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$10675.11