



Backtest #56544 · GOOGL · EVO_EVOEVOEVOE_v792

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 con la estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v792 muestra un ROI del 6.75% pero con una tasa de victoria del 33.3% y un máximo de caída del 15.79%, lo que indica una exposición alta al riesgo en solo tres operaciones. Un ratio Sharpe de 0.54 sugiere que los retornos no compensan adecuadamente la volatilidad, y la pequeña muestra de tres operaciones genera poca confianza estadística para validar la robustez del modelo. La estrategia parece demasiado sensible a movimientos de corto plazo o carece de filtros de entrada efectivos para capturar la tendencia de este activo. Para mejorar, es necesario aumentar el volumen de pruebas con datos históricos extendidos y ajustar los parámetros de umbral de entrada para reducir la frecuencia de pérdidas.

ADDITIONAL METRICS

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