



Backtest #1358 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v896

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+3.84%	0.34	25.0%	-12.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AAPL con EVO_GG1RSISNIP_v896 muestra un ROI del +3.84%, pero el Sharpe de 0.34 y un drawdown del 12.60% revelan un perfil de riesgo excesivo para el retorno obtenido. Con solo 4 operaciones y una tasa de aciertos del 25%, la muestra es estadísticamente insignificante, por lo que los resultados carecen de solidez predictiva. La estrategia parece ser una de alta varianza, donde las pocas ganancias no compensan adecuadamente el riesgo asumido. Se requiere una optimización urgente de los parámetros de entrada y un backtest expandido a múltiples regímenes de mercado para validar la robustez del modelo antes de cualquier consideración de capital real.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	3.84%
Sortino Ratio	0.25
Turnover	8.02x
Total Trades	4
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$10386.91