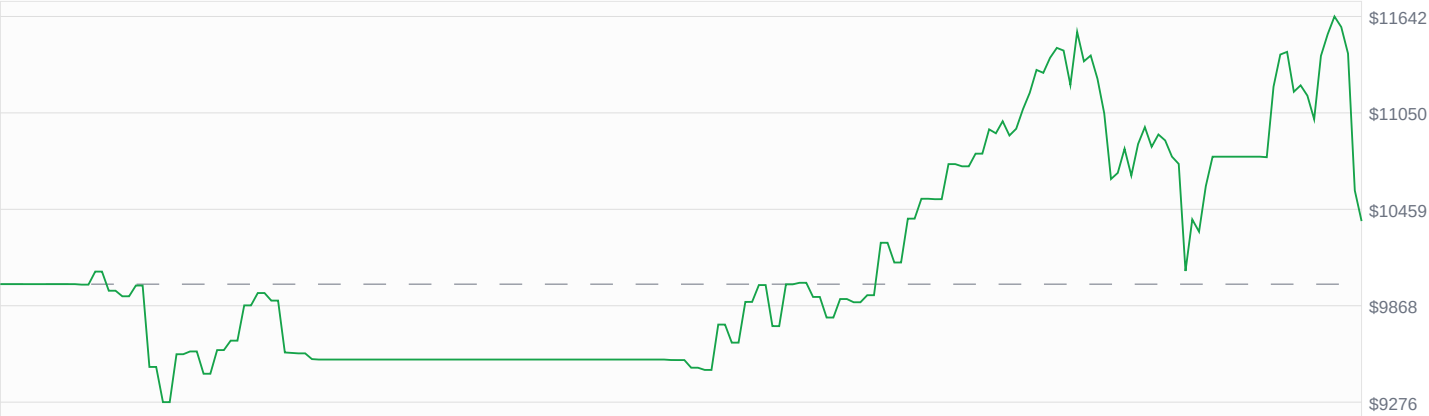




Backtest #2564 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v1205

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_v1205 muestra un ROI marginal de +3.84% con un Sharpe de apenas 0.34, lo que indica rendimiento ajustado al riesgo muy por debajo de estándares institucionales. La tasa de aciertos del 25% sobre solo 4 trades revela una muestra estadísticamente insignificante — no se puede confiar en patrones de comportamiento con n=4. La estrategia genera una ganancia modesta exclusivamente porque el trade #3 (abril-julio) capturó un movimiento alcista de +\$1,246, mientras que los 3 trades restantes fueron perdedores. El drawdown máximo del -12.60% es desproporcionadamente alto comparado con el retorno final, lo que sugiere que la estrategia no gestiona adecuadamente las pérdidas. El siguiente paso concreto es

ADDITIONAL METRICS

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