



Backtest #30536 · AAPL · EVO_EVOEVOEVOE_v1836

ROI

+4.70%

Sharpe

0.38

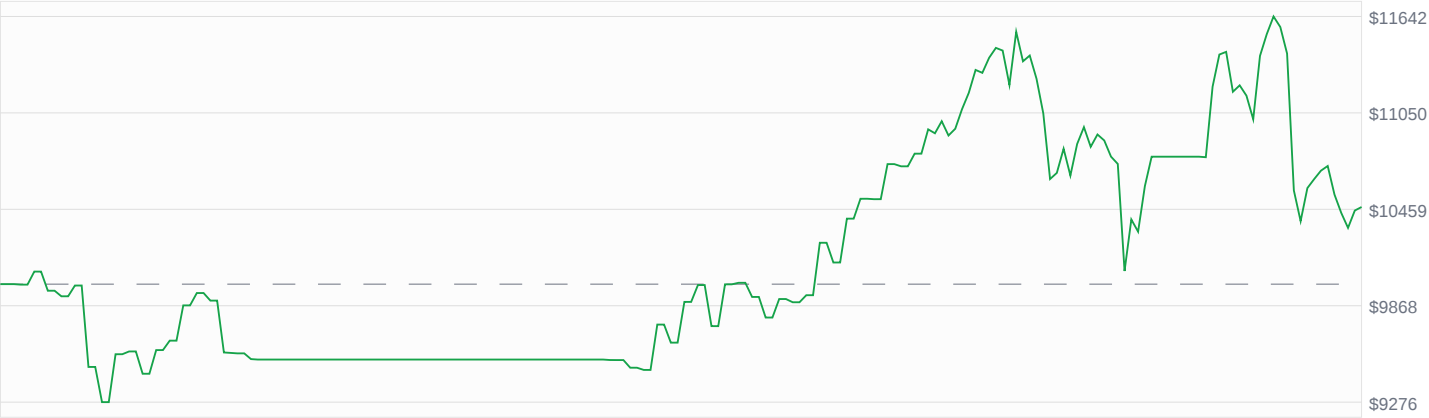
Win Rate

25.0%

Max Drawdown

-12.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTEHera local LLM

El backtest de EVO_EVOEVOEVOE_v1836 en AAPL revela un ROI positivo del 4.70%, aunque con una tasa de ganancia tan baja como 25%, lo que sugiere un bajo nivel de confianza estadística dada la muestra de solo 4 operaciones. La baja relación Sharpe (0.38) indica que el riesgo no está siendo compensado adecuadamente, y el máximo drawdown del 12.6% refleja una volatilidad significativa. El siguiente paso concreto sería aumentar el tamaño de la muestra de backtest a al menos 20 operaciones para validar la robustez del modelo antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	4.70%
Sortino Ratio	0.30
Turnover	8.03x
Total Trades	4
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$10473.18