



Backtest #30793 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v58

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+4.70%	0.38	25.0%	-12.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v58 mostró un ROI de +4.70% en AAPL, pero con un win rate de solo 25% y un max drawdown del 12.60%, lo que indica alta volatilidad y poca confiabilidad estadística dada la muestra de solo 4 operaciones. El Sharpe ratio de 0.38 sugiere que el retorno no justifica el riesgo asumido. Se recomienda aumentar el tamaño de backtest a mínimo 30 operaciones antes de considerar su implementación en producción.

ADDITIONAL METRICS

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