



Backtest #3087 · AAPL · EVO_EVOEVOEVOE_v1857

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

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTEHera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v1857 sobre AAPL muestra un ROI modesto del +3.84% con un Sharpe de solo 0.34, lo que indica rendimiento ajustado al riesgo insuficiente. Con un win rate de apenas 25% en tan solo 4 operaciones, la muestra es estadísticamente insignificante para confiar en la robustez del modelo. La máxima caída del 12.60% resulta desproporcionada respecto al beneficio final, señalando asimetría negativa. Se requiere ampliar significativamente la ventana de backtest y el número de trades para validar si la estrategia genera alfa real o simplemente ruido. Hasta entonces, no se recomienda su implementación en cuenta real.

ADDITIONAL METRICS

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