



Backtest #31435 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v231

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_v231 mostró un ROI de +4.70% en AAPL, pero con una tasa de ganancia del 25%, lo cual sugiere un bajo nivel de confianza estadística dada la muestra de solo 4 operaciones. El Sharpe de 0.38 indica un rendimiento ajustado al riesgo débil, y un drawdown máximo del 12.6% revela altos riesgos en la estrategia actual. Se recomienda aumentar el número de trades a al menos 20 para obtener una mejor estimación de los parámetros antes de considerar una optimización adicional.

ADDITIONAL METRICS

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