



Backtest #31529 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v407

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_v407 mostró un ROI de +4.70% con Sharpe de 0.38, aunque su baja tasa de ganancia del 25% y drawdown máximo del 12.60% indican alta volatilidad y riesgo. Con solo 4 operaciones, la muestra es demasiado pequeña para confianza estadística sólida, requiriendo más backtests para validar la estrategia. El próximo paso es aumentar el número de trades a 20+ para mejorar la precisión del Sharpe y reducir el riesgo de overfitting. La estrategia necesita más datos para validar su robustez.

ADDITIONAL METRICS

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