



Backtest #31763 · AAPL · EVO\_GG1RSISNIP\_v263

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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

El backtest de EVO\_GG1RSISNIP\_v263 en AAPL muestra un ROI de +4.70% con Sharpe ratio de 0.38, pero win rate del 25% indica alta volatilidad y bajo confianza estadística dada la muestra de solo 4 operaciones. La estrategia funciona en tendencia alcista, pero su baja efectividad en señales requiere ajustes en parámetros de entrada. Se recomienda validar la estrategia con más datos históricos y aumentar el volumen de trades para mejorar la estabilidad del rendimiento. El análisis sugiere que la estrategia tiene potencial, pero necesita mayor robustez para ser considerada en entornos de trading institucional.

ADDITIONAL METRICS

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