



Backtest #31951 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v359

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+4.11%	0.35	25.0%	-12.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de EVO_GG1RSISNIP_v359 en AAPL muestra un ROI de +4.11% con Sharpe de 0.35, pero un win rate de solo 25% lo que indica baja confiabilidad estadística dada la muestra de solo 4 operaciones. Aunque el modelo identificó oportunidades de trading, su baja tasa de acierto sugiere que necesita optimización de señales antes de considerar su implementación. Una próxima iteración debería enfocarse en mejorar el filtro de entrada para aumentar la proporción de operaciones ganadoras y validar la estrategia con un dataset más amplio. El drawdown máximo de 12.6% también representa un riesgo significativo que debe abordarse con parámetros de gestión de riesgo más estrictos.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	4.11%
Sortino Ratio	0.27
Turnover	8.02x
Total Trades	4
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$10413.95