



Backtest #31957 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v426

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_v426 para AAPL muestra un ROI positivo del 4.11% con Sharpe ratio de 0.35, aunque el win rate de solo 25% refleja baja confiabilidad estadística dada la muestra de solo 4 operaciones. El drawdown máximo de 12.6% indica alta volatilidad en este periodo de prueba. La estrategia no logró superar el umbral de confianza estadística con tan pocos trades, por lo que se requiere una ampliación del backtest a más operaciones para validación. Se recomienda realizar una nueva simulación con al menos 20 trades adicionales para evaluar la robustez del algoritmo antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

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