



Backtest #32065 · AAPL · EVO_EVOWEBIDEA_v424

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 AAPL con la estrategia EVO_EVOWEBIDEA_v424 muestra un ROI positivo del 4.11%, pero con una tasa de ganancia del 25% y una máxima retracción del 12.60%, lo cual indica una baja confianza estadística dada la muestra de solo 4 operaciones. A pesar del Sharpe ratio de 0.35, la baja tasa de ganancia sugiere que el modelo necesita ajustes en sus señales de entrada y salida. Se recomienda aumentar el número de trades a al menos 20 para mejorar la robustez estadística y evaluar si el modelo puede ser ajustado con señales adicionales. La estrategia requiere mayor volumen de datos para validar su capacidad de generar alpha sistemático.

ADDITIONAL METRICS

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