



Backtest #32094 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v465

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_GG1RSISNIP_v465 muestra un ROI de +4.11% con Sharpe ratio de 0.35, pero un win rate de solo 25%, lo cual indica baja confiabilidad estadística dada la muestra de solo 4 operaciones. A pesar de su rentabilidad, la baja tasa de ganancia y el alto drawdown sugieren que el modelo carece de consistencia en la señal de entrada. Dado el tamaño limitado de las operaciones, se recomienda validar esta estrategia con un backtest extendido a más de 20 trades para mejorar la confianza estadística del modelo. La próxima acción sería aumentar el volumen de prueba para validar la robustez del algoritmo.

ADDITIONAL METRICS

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