



Backtest #32138 · AAPL · EVO_EVOEVOEVOE_v2040

ROI

+4.11%

Sharpe

0.35

Win Rate

25.0%

Max Drawdown

-12.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v2040 mostró un ROI de +4.11% en 4 trades con un win rate del 25%, lo cual indica alta volatilidad y poca consistencia. El Sharpe de 0.35 sugiere que el riesgo no está compensado adecuadamente, y un drawdown máximo del 12.6% revela una exposición significativa al riesgo. Con solo 4 operaciones, la muestra carece de confiabilidad estadística. El siguiente paso sería aumentar el volumen de backtests y ajustar los parámetros de entrada para mejorar la robustez del modelo.

ADDITIONAL METRICS

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