



Backtest #32167 · AAPL · EVO\_GG1RSISNIP\_v359

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| ROI    | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +6.26% | 0.47   | 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 positivo del 6.26%, pero con solo 4 trades, la muestra es insuficiente para inferir significado estadístico. El Sharpe de 0.47 sugiere retorno moderado frente al riesgo, pero la baja tasa de ganancia (25%) y drawdown del 12.60% indican volatilidad alta. La estrategia necesita más datos para validar su robustez. Próximo paso: expandir el backtest a 100+ trades con diferentes intervalos.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 6.26%      |
| Sortino Ratio   | 0.37       |
| Turnover        | 8.04x      |
| Total Trades    | 4          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$10629.28 |