



Backtest #32383 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v359

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+6.14%	0.46	25.0%	-12.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest muestra un ROI positivo del 6.14% con solo 4 operaciones, lo que indica una muestra estadísticamente insuficiente para validar la estrategia. El ratio Sharpe de 0.46 sugiere retorno moderado frente al riesgo, pero el 25% de ganancias y un drawdown del 12.60% destacan volatilidad. La muestra extremadamente pequeña (4 trades) invalida cualquier conclusión sólida. Próximos pasos: expandir el backtest a 100+ operaciones para validar la consistencia.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	6.14%
Sortino Ratio	0.36
Turnover	8.04x
Total Trades	4
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$10617.64