



Backtest #32602 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v302

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+7.98%	0.57	50.0%	-12.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest muestra un ROI positivo del 7.98% con 4 operaciones, pero su Sharpe de 0.57 y max drawdown del 12.6% indican riesgo elevado. La muestra es demasiado pequeña (4 trades) para confiar en resultados estadísticos. El 50% de ganancia y pérdida es neutral, pero la falta de diversificación y volumen limitado invalidan su robustez. Próximo paso: extender el período de backtest a 100+ operaciones para validar la estrategia.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	7.98%
Sortino Ratio	0.44
Turnover	8.06x
Total Trades	4
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10800.78