



Backtest #34264 · AAPL · AAPL · GG-Bollinger-RSI-Options (test)

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 un Sharpe de 0.57, pero solo 4 operaciones limitan la confiabilidad estadística. La mitad de las ganancias y un drawdown del 12.60% reflejan volatilidad y falta de consistencia. El tamaño muestral extremadamente pequeño (4 trades) invalida conclusiones sólidas. Next step: expandir el historial de datos para validar el desempeño en condiciones más robustas.

ADDITIONAL METRICS

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