



Backtest #34415 · AAPL · EVO\_GG1RSISNIP\_v1006

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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 una rentabilidad del 7.98% con un ratio Sharpe de 0.57, pero solo 4 operaciones limitan la significancia estadística. La mitad de las ganancias se equilibra con pérdidas, mientras que el drawdown máximo de 12.6% sugiere exposición a volatilidad. La muestra es demasiado pequeña para confiar en resultados sólidos; se necesita un período de prueba más largo para validar la estrategia. Next step: ampliar el horizonte temporal del backtest a al menos 100 operaciones.

ADDITIONAL METRICS

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