



Backtest #35491 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v359

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+6.53%	0.49	25.0%	-12.60%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AAPL muestra un ROI positivo del 6.53% con una ganancia neta de \$656.26, pero la eficiencia estadística es crítica debido a la muestra extremadamente pequeña de solo cuatro operaciones. Un ratio de Sharpe bajo de 0.49 junto con una tasa de éxito del 25% sugieren que las ganancias provienen de pocos eventos de alta varianza en lugar de una consistencia operativa robusta. El riesgo de sobreajuste es alto, dado que un drawdown del 12.60% indica sensibilidad a condiciones de mercado adversas específicas del período probado. Se requiere ampliar la ventana de backtest con más datos históricos para validar si esta estrategia genera alfa real o ruido aleatorio antes de cualquier implementación.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	6.53%
Sortino Ratio	0.38
Turnover	8.05x
Total Trades	4
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$10656.26