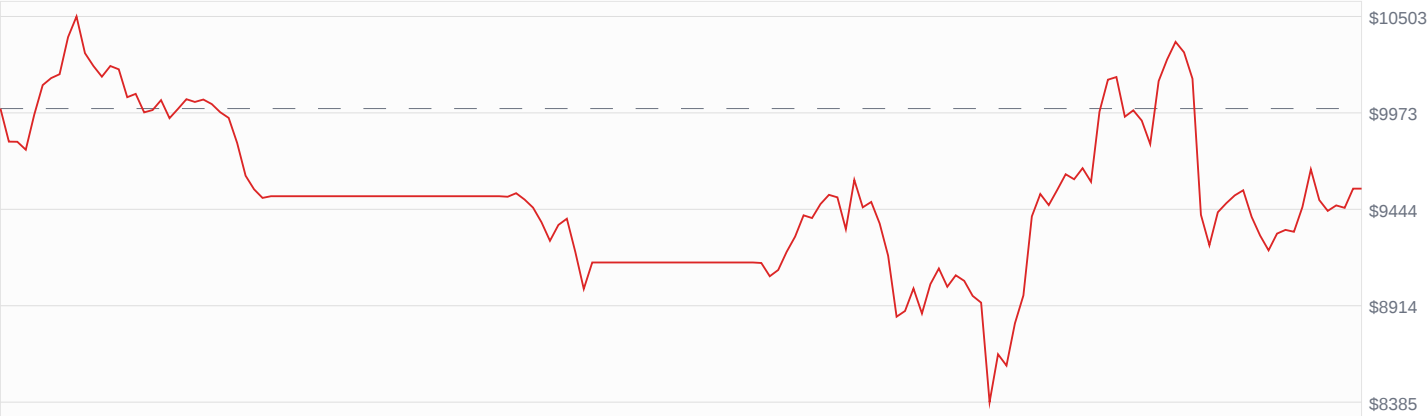




Backtest #37119 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v446

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-4.43%	-0.21	33.3%	-20.17%

EQUITY CURVE162 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AAPL para EVO_GG1RSISNIP_v446 muestra un rendimiento negativo del 4.43% con una tasa de ganancia del 33.3% y un drawdown máximo del 20.17%, lo que indica una estrategia ineficiente en este periodo. La relación de Sharpe de -0.21 confirma una generación de alfa negativa, exacerbada por un volumen de solo tres operaciones que impide cualquier conclusión estadísticamente significativa sobre la robustez del modelo. La falta de diversidad en las transacciones sugiere que el filtro de entrada o el tamaño de posición podrían estar generando riesgos asimétricos que no están siendo adecuadamente compensados. Se requiere un análisis de sensibilidad para ajustar los parámetros de entrada y aumentar el número de señales antes de

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-5.24%
Sortino Ratio	-0.17
Turnover	6.76x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$9557.19