



Backtest #3819 · AAPL · EVO\_GG1RSISNIP\_v1422

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| ROI    | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| +3.84% | 0.34   | 25.0%    | -12.60%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v1422 en AAPL generó un ROI del +3.84%, pero el Sharpe de 0.34 y una drawdown máxima del 12.60% reflejan un perfil de riesgo ineficiente. Con solo 4 operaciones y un win rate del 25%, los resultados carecen de significancia estadística y podrían deberse al azar. La alta volatilidad por trade sugiere que el modelo no está filtrando adecuadamente el ruido del mercado. Se recomienda ejecutar walk-forward analysis con al menos 50 trades para validar la robustez antes de considerar implementación real.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | 3.84%      |
| Sortino Ratio   | 0.25       |
| Turnover        | 8.02x      |
| Total Trades    | 4          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$10386.91 |