



Backtest #38196 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v84

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+10.70%	0.87	50.0%	-11.50%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AAPL con EVO_GG1RSISNIP_v84 muestra un retorno del 10.70% sobre solo dos operaciones, lo que genera una falta total de confianza estadística y alta varianza. Aunque la tasa de aciertos es del 50%, el ratio de Sharpe bajo de 0.87 indica un riesgo no compensado por el rendimiento. La caída máxima del 11.50% sugiere una exposición significativa sin suficientes datos para validar la gestión de capital. Dada la muestra insuficiente, el siguiente paso crítico es ejecutar una simulación extendida para validar la consistencia de los resultados antes de considerar su despliegue.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	10.70%
Sortino Ratio	0.47
Turnover	4.34x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$11069.61