



Backtest #3823 · 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

EVO_GG1RSISNIP_v1422 generó un ROI del +3.84% en AAPL, pero el Sharpe de 0.34 y un Max Drawdown del 12.60% revelan una gestión de riesgo deficiente. La tasa de aciertos del 25% con solo 4 operaciones en 1d indica una muestra estadísticamente insignificante, donde el edge es indistinguible del ruido. La curva de capital muestra una caída severa a ~\$9.2K antes de una recuperación tardía, típica de estrategias de alta varianza. Se requiere expandir el backtest a un mínimo de 50 trades antes de cualquier optimización.

ADDITIONAL METRICS

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