



Backtest #3826 · 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

El backtest de AAPL con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1422 muestra un ROI modesto de +3.84%, pero con un Sharpe ratio bajo (0.34), lo que indica que el rendimiento ajustado al riesgo es mediocre. La tasa de aciertos del 25% es extremadamente baja, sugiriendo que la estrategia depende de unos pocos trades ganadores grandes para compensar las pérdidas frecuentes. Con solo 4 trades, la muestra estadística es insuficiente para confiar en los resultados, y el drawdown máximo del 12.60% es desproporcionadamente alto en relación con el ROI, lo que refleja una gestión de riesgo deficiente. Se recomienda aumentar el número de trades mediante la optimización de parámetros o la expansión del período de backtest para evaluar la robustez de la

ADDITIONAL METRICS

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