



Backtest #4473 · AAPL · EVO_EVOEVOEVOE_v1730

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

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTEHera local LLM

La estrategia EVO_EVOEVOEVOE_v1730 sobre AAPL generó un ROI del +3.84% con una tasa de acierto del 25.0%, lo cual es insuficiente para establecer confianza estadística con solo 4 operaciones. El Sharpe ratio de 0.34 refleja un rendimiento ajustado al riesgo mediocre, y el drawdown máximo del 12.60% es desproporcionado para el capital generado, evidenciando una gestión de riesgo deficiente. Esta muestra es estadísticamente irrelevante y no permite generalizar la robustez del modelo. Se requiere expandir drásticamente el backtest a múltiples rangos temporales y activos para validar cualquier señal de alfa antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

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