



Backtest #45243 · AAPL · Swing Pullback AAPL

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 la estrategia "Swing Pullback AAPL" muestra un ROI positivo del 10.70% con una ratio de Sharpe de 0.87, indicando un buen retorno ajustado al riesgo. Sin embargo, la baja tasa de ganancia del 50% y un drawdown máximo del 11.50% sugieren que la estrategia tiene vulnerabilidades en la gestión de riesgos. Con solo 2 operaciones, la muestra es muy pequeña para afirmar con confianza estadística los resultados. La estrategia funciona mejor en tendencias alcistas claras pero falla en entornos volátiles. Se recomienda aumentar el número de trades a mínimo 20 para validar la estrategia.

ADDITIONAL METRICS

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