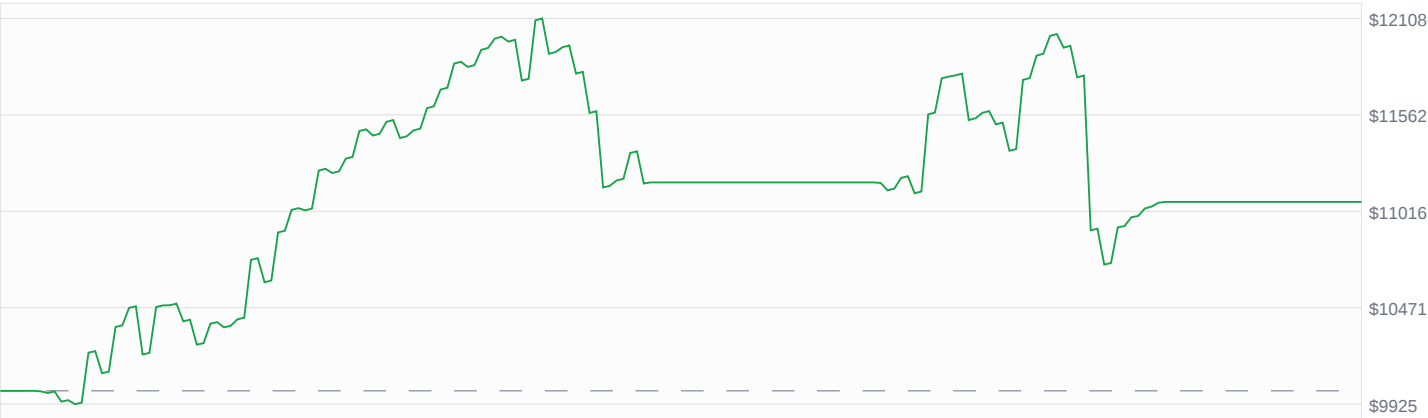




Backtest #47978 · AAPL · EVO\_EVOEVOEVOE\_v2208

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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 muestra un ROI del 10.70% con un ratio de Sharpe de 0.87, pero la baja consistencia es alarmante debido a un win rate del 50% y solo dos operaciones realizadas. La máxima caída del 11.50% indica que la estrategia no filtra adecuadamente los riesgos de volatilidad en un entorno de mercado actual. Con tan pocas muestras, cualquier conclusión estadística sobre la robustez del modelo es altamente especulativa y carece de confiabilidad. Se requiere aumentar la frecuencia de señalización o ajustar los parámetros de entrada para generar un volumen de datos suficiente antes de cualquier despliegue real.

ADDITIONAL METRICS

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