



Backtest #51248 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v253

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

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v253 mostró un retorno del 10.70% sobre una muestra crítica de solo dos operaciones, lo que genera una confianza estadística insuficiente para cualquier conclusión robusta. El ratio de Sharpe de 0.87 sugiere un perfil de riesgo moderado, pero la tasa de éxito del 50% y un drawdown máximo del 11.5% indican una alta volatilidad inherente al parámetro actual. Con tan pocos datos, el resultado parece más producto de la suerte que de una ventaja de mercado consistente. Se requiere ampliar el backtest con más periodos o reducir el tamaño de la muestra para validar la robustez del sistema antes de considerarlo operativo.

ADDITIONAL METRICS

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