



Backtest #6438 · AAPL · EVO\_EVOVELOCIT\_v1529

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| 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

La muestra de 4 trades es estadísticamente insuficiente para confiar en un ROI de +3.84%; el Sharpe de 0.34 y la win rate del 25% revelan fragilidad, no edge. La drawdown del 12.60% es desproporcionada para tan pocos trades, sugiriendo falta de filtro de riesgo. Necesitas al menos 50+ trades para validar la significancia estadística. Próximo paso: ampliar el backtest a 2+ años y filtrar con validación walk-forward antes de cualquier decisión.

ADDITIONAL METRICS

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