



Backtest #8654 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v1566

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

El backtest de AAPL con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1566 muestra un ROI de +3.84%, pero con una tasa de ganancia del 25% y un drawdown máximo del 12.60%, lo que sugiere alta volatilidad y poca confiabilidad estadística con solo 4 operaciones. El ratio de Sharpe de 0.34 indica un rendimiento ajustado al riesgo muy bajo. Se recomienda aumentar el tamaño de la muestra a al menos 20 operaciones para validar la estrategia antes de considerar su implementación en entornos de trading institucional.

ADDITIONAL METRICS

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