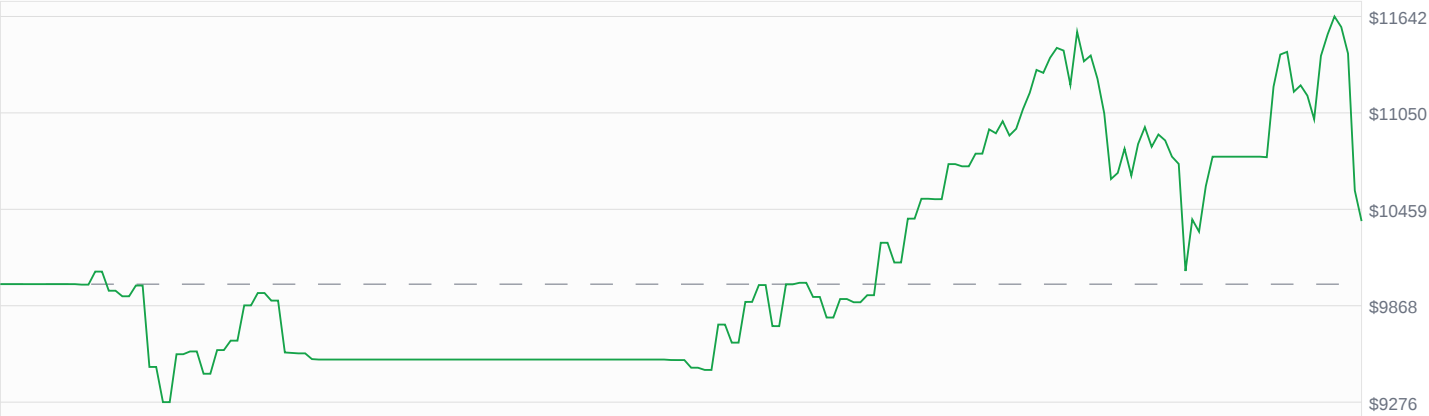




Backtest #8666 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v1566

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

La estrategia muestra un ROI modesto de 3.84% con una rentabilidad ajustada al riesgo deficiente (Sharpe 0.34) y una tasa de aciertos crítica del 25%. Una caída máxima del 12.60% sugiere una exposición al riesgo excesiva para tan pocos movimientos, mientras que cuatro operaciones son estadísticamente insignificantes para validar cualquier hipótesis algorítmica. La distribución de resultados parece dominada por pérdidas que fueron recuperadas por un único acierto, lo que invalida la robustez del modelo actual. Se requiere un backtest extendido con miles de operaciones para confirmar si la selectividad es real o simplemente ruido aleatorio.

ADDITIONAL METRICS

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