



Backtest #9222 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v1576

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 EVO_GG1RSISNIP_v1576 en AAPL muestra un ROI de +3.84% con Sharpe de 0.34, pero con una tasa de ganancia del 25% y un drawdown máximo del 12.60%, lo que indica alta volatilidad y poca confianza estadística por la muestra pequeña de solo 4 operaciones. El modelo no capturó bien el comportamiento del activo, sugiriendo una revisión del filtro de entrada para evitar señales falsas. Se recomienda aumentar el tamaño de la muestra a mínimo 20 operaciones antes de considerar una optimización del modelo.

ADDITIONAL METRICS

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