



Backtest #41196 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v1564

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_v1564 en AAPL generó un ROI del 10.70% con un ratio de Sharpe moderado de 0.87, pero solo dos operaciones limitan severamente la confianza estadística de estos resultados. Un drawdown del 11.50% indica volatilidad no controlada, mientras que una tasa de acierto del 50% sugiere que la señal carece de un factor predictivo robusto. Con una muestra tan pequeña, el rendimiento actual podría ser pura suerte y no una ventaja persistente del mercado. Se requiere expandir el backtest a datos históricos más amplios para validar si esta lógica operativa es reproducible o un caso aislado.

ADDITIONAL METRICS

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