



Backtest #47782 · AAPL · EVO\_GG1RSISNIP\_v1489

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

El backtest de AAPL para EVO\_GG1RSISNIP\_v1489 muestra una rentabilidad del 10.70% con una tasa de ganancia del 50.0%, pero la confiabilidad estadística es crítica al haber ejecutado solo dos operaciones. La relación de Sharpe de 0.87 sugiere un rendimiento ajustado al riesgo moderado, aunque la caída máxima del 11.50% indica vulnerabilidad ante movimientos adversos. La muestra de datos es insuficiente para validar la estrategia bajo condiciones de mercado diversas, lo que genera un alto nivel de incertidumbre sobre su robustez futura. Se requiere ampliar el período de pruebas y ajustar los parámetros de entrada para generar un historial más significativo antes de considerar su implementación operativa.

ADDITIONAL METRICS

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