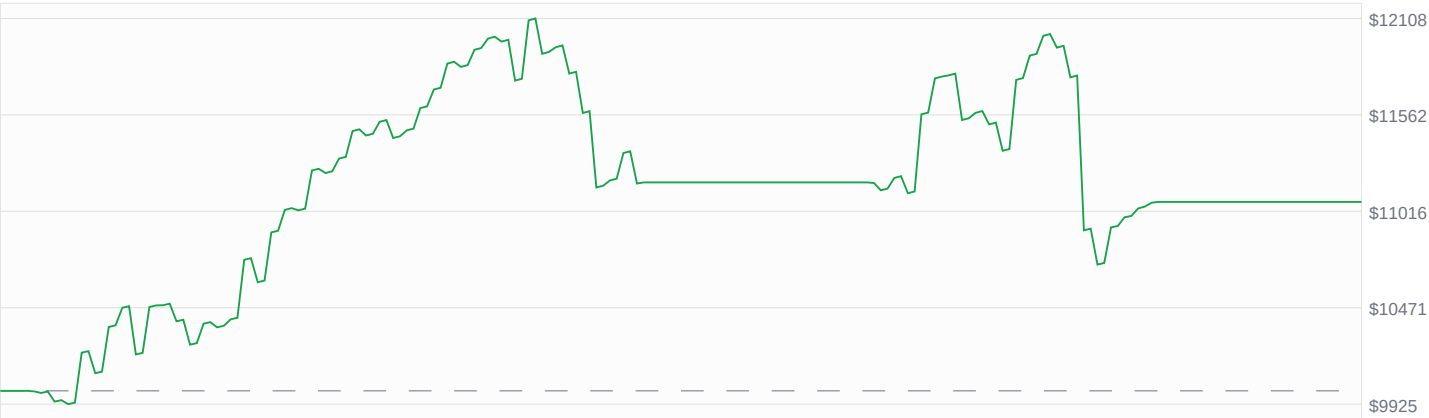




Backtest #51799 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v1612

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_v1612 en AAPL generó un ROI del 10.7% con un drawdown máximo del 11.5%, pero un win rate del 50% y una tasa de Sharpe de 0.87 indican una eficiencia de riesgo muy baja. La muestra de solo dos operaciones es insuficiente para establecer estadística significativa o validar la robustez del modelo ante distintos regímenes de mercado. La alta volatilidad relativa al retorno sugiere que el filtro de entrada es demasiado sensible a ruido o falta de confirmación técnica. Se requiere ampliar el backtest a múltiples años para calcular un intervalo de confianza válido antes de considerar una implementación real.

ADDITIONAL METRICS

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