



Backtest #53699 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v1536

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 con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1536 muestra una ganancia neta del 10.70% con un ratio Sharpe moderado de 0.87, pero la alta volatilidad de un drawdown del 11.50% y una tasa de éxito del 50% en solo dos operaciones revelan una falta crítica de robustez estadística. La rentabilidad observada carece de confianza significativa debido al mínimo tamaño muestral, lo que impide discernir si el rendimiento es fruto de la estrategia o de una suerte transitoria en un mercado específico. Se requiere expandir el período de prueba y aumentar la frecuencia de operaciones para validar la consistencia de los parámetros actuales 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