



Backtest #55045 · AAPL · EVO_EVOEVOEVOE_v2065

ROI

+10.70%

Sharpe

0.87

Win Rate

50.0%

Max Drawdown

-11.50%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTEHera local LLM

El testeo de AAPL para EVO_EVOEVOEVOE_v2065 muestra un rendimiento positivo del 10.70%, pero una ganancia neta de solo dos operaciones limita severamente la confiabilidad estadística de los resultados. La baja tasa de aciertos del 50% y una relación Sharpe de 0.87 sugieren que la estrategia no posee un factor de riesgo-recompensa robusto más allá del azar. Un retroceso máximo del 11.50% indica volatilidad no gestionada dentro de la muestra, lo que hace imposible validar la consistencia del modelo actual. Dado el tamaño insuficiente de la muestra, se requiere ampliar el rango temporal y ajustar los parámetros para reducir el ruido estocástico. La siguiente acción debe ser recopilar más datos históricos antes de considerar una

ADDITIONAL METRICS

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