



Backtest #48327 · AAPL · EVO_EVOEVOEVOE_v1688

ROI

+10.70%

Sharpe

0.87

Win Rate

50.0%

Max Drawdown

-11.50%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AAPL muestra un rendimiento positivo del 10.7%, pero un coeficiente de Sharpe bajo de 0.87 indica una compensación riesgo-rendimiento mediocre. La tasa de acierto del 50% y el máximo retroceso del 11.5% sugieren que la estrategia carece de un filtro de tendencia robusto. Con solo dos operaciones, el resultado carece de significado estadístico y no permite validar la consistencia del modelo. La falta de volumen de datos impide confirmar si el beneficio fue producto de la suerte o de una lógica sólida. La siguiente acción debe ser ampliar el rango temporal para generar suficientes muestras y validar la estabilidad de las métricas antes de cualquier despliegue.

ADDITIONAL METRICS

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