



Backtest #48857 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v1138

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 muestra un rendimiento positivo del 10.70% con un ratio de Sharpe de 0.87, pero la muestra de solo dos operaciones genera una incertidumbre estadística extrema que invalida cualquier conclusión robusta. La tasa de aciertos del 50% y un máximo de caída del 11.50% sugieren una estrategia vulnerable a la varianza en lugar de una ventaja real consistente. Se requiere aumentar el número de pruebas o ajustar parámetros para obtener datos suficientes antes de considerar la implementación. El siguiente paso crítico es ejecutar una nueva simulación con condiciones de mercado diferentes para validar la estabilidad de los resultados actuales.

ADDITIONAL METRICS

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