



Backtest #52513 · AAPL · EVO_GG1RSISNIP_v1171

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 con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1171 muestra un retorno del 10.70%, pero una tasa de victoria del 50% y solo dos operaciones indican una señalización estocástica sin robustez estadística. La alta volatilidad capturada, reflejada en un máximo de caída del 11.50% y una relación de Sharpe de 0.87, sugiere que el rendimiento no proviene de una ventaja alfa consistente sino del riesgo asumido en posiciones pocas. Sin un historial más amplio para confirmar patrones, los resultados actuales carecen de fiabilidad para una implementación institucional. Se requiere ampliar el periodo de prueba y validar el comportamiento en diferentes regímenes de mercado antes de considerar cualquier acción.

ADDITIONAL METRICS

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