



Backtest #29051 · AMZN · EVO\_GG1RSISNIP\_v354

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -12.04% | -0.94  | 33.3%    | -17.14%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v354 mostró resultados negativos en AMZN con un ROI de -12.04% y Sharpe ratio de -0.94, indicando que el sistema no generó valor. Solo 3 operaciones realizadas limitan la confiabilidad estadística del modelo, con una tasa de ganancia del 33.3%, lo que sugiere un alto riesgo de pérdida. No se recomienda continuar con esta configuración debido a la falta de consistencia y la baja eficiencia del capital. Una posible solución sería aumentar el número de operaciones a más de 20 para mejorar la robustez del backtest.

ADDITIONAL METRICS

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| CAGR            | -12.04%   |
| Sortino Ratio   | -0.59     |
| Turnover        | 5.28x     |
| Total Trades    | 3         |
| Initial Capital | \$9997.00 |
| Final Capital   | \$8796.05 |