



Backtest #30246 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v267

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_v267 presentó un rendimiento negativo del 12.04% en AMZN, con una razón de información de -0.94 y una tasa de ganancia del 33.3%, basada en solo 3 operaciones, lo que sugiere baja confianza estadística y alta volatilidad en el backtest. El máximo drawdown del 17.14% indica una exposición de riesgo significativa, y el capital final fue de \$8796.05, lo cual no refleja una estrategia viable. La siguiente acción concreta es aumentar el tamaño de muestra a al menos 30 operaciones para evaluar la robustez del modelo con mayor confianza.

ADDITIONAL METRICS

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