



Backtest #30586 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v249

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

El backtest de EVO_GG1RSISNIP_v249 en AMZN revela un rendimiento negativo con ROI de -12.04%, Sharpe ratio de -0.94 y una tasa de ganancia del 33.3% tras solo 3 operaciones, lo que sugiere un bajo nivel de confianza estadística. A pesar de algunas señales positivas, la estrategia presenta un comportamiento volátil y no se ajusta adecuadamente al riesgo. Una siguiente acción sería aumentar el número de trades a al menos 20 para validar la robustez del modelo antes de considerar su implementación.

ADDITIONAL METRICS

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