



Backtest #30732 · AMZN · EVO\_GG1RSISNIP\_v23

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| 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 AMZN con la estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v23 revela un rendimiento negativo con una ROI de -12.04% y una ratio de Sharpe de -0.94, indicando que la estrategia no fue rentable. El win rate del 33.3% y el drawdown máximo del 17.14% sugieren que la estrategia carece de consistencia y tiene un alto riesgo. Dado que solo se realizaron 3 operaciones, la muestra es muy pequeña para sacar conclusiones estadísticamente significativas. Se recomienda aumentar el número de trades a al menos 50 para mejorar la confianza en los resultados y realizar una revisión de los parámetros de entrada para optimizar el sistema.

ADDITIONAL METRICS

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