



Backtest #31532 · 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 en AMZN con una ROI de -12.04% y Sharpe ratio de -0.94, indicando que el sistema no capturó valor. El win rate del 33.3% sugiere que el filtro de entrada falló en la muestra de solo 3 operaciones, lo cual no proporciona confianza estadística sólida. La baja frecuencia de trades y el alto drawdown máximo (-17.14%) revelan que el sistema tiene dificultades de robustez. La próxima acción debe ser reentrenar el modelo con un dataset más amplio para aumentar el número de trades válidos y mejorar la estabilidad del sistema.

ADDITIONAL METRICS

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