



Backtest #31978 · 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

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v249 presentó un rendimiento negativo del 12.04% en AMZN, con una proporción Sharpe de -0.94, lo que indica que el riesgo no fue compensado por el retorno. La tasa de ganancia del 33.3% es insuficiente para considerar esta estrategia rentable, y el drawdown máximo del 17.14% revela una alta volatilidad en el periodo analizado. Con solo 3 operaciones, la muestra es demasiado pequeña para establecer una confianza estadística sólida. La siguiente medida concreta es aumentar el número de trades simulados a al menos 30 para obtener un análisis más robusto antes de considerar ajustes en la estrategia.

ADDITIONAL METRICS

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