



Backtest #32068 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v338

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_v338 presentó un rendimiento negativo del -12.04% en AMZN, con una relación Sharpe de -0.94, lo que indica una falta de capacidad de generación de alpha. La baja tasa de ganancia del 33.3% sugiere que el modelo tiene dificultades para identificar señales rentables, y el drawdown máximo del 17.14% refleja altos riesgos de capital. Con solo 3 operaciones, la muestra es muy pequeña para validar la estabilidad del modelo, por lo que se recomienda aumentar el número de trades para mejorar la confianza estadística antes de considerar una optimización. La próxima acción es validar el modelo con un dataset más amplio, al menos con 50 operaciones.

ADDITIONAL METRICS

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