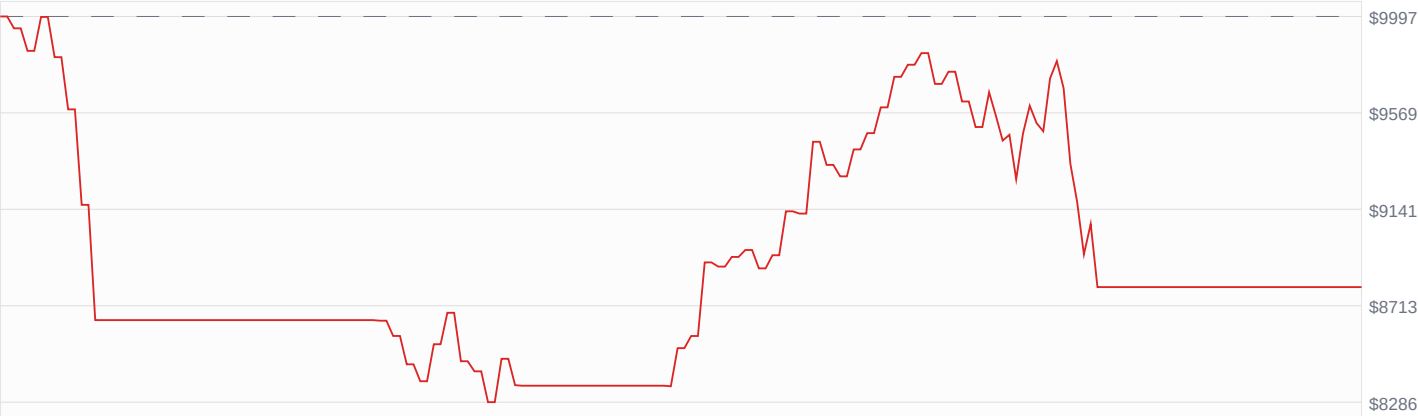




Backtest #36220 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v365

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_v365 presenta un resultado negativo del 12.04% en un contexto de solo tres operaciones. La baja tasa de éxito del 33.3% y un drawdown máximo del 17.14% indican que el ruido del mercado superó a la señal en esta muestra limitada. Con un ratio de Sharpe de -0.94, la estrategia no ha demostrado capacidad consistente para generar retornos ajustados al riesgo en este periodo. Dada la pequeña muestra, la estadística actual carece de poder suficiente para validar la robustez del modelo frente a condiciones de mercado diversas. La siguiente acción prioritaria es ejecutar un backtest ampliando el periodo histórico al menos diez años para filtrar sesgos temporales y reevaluar los parámetros de

ADDITIONAL METRICS

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