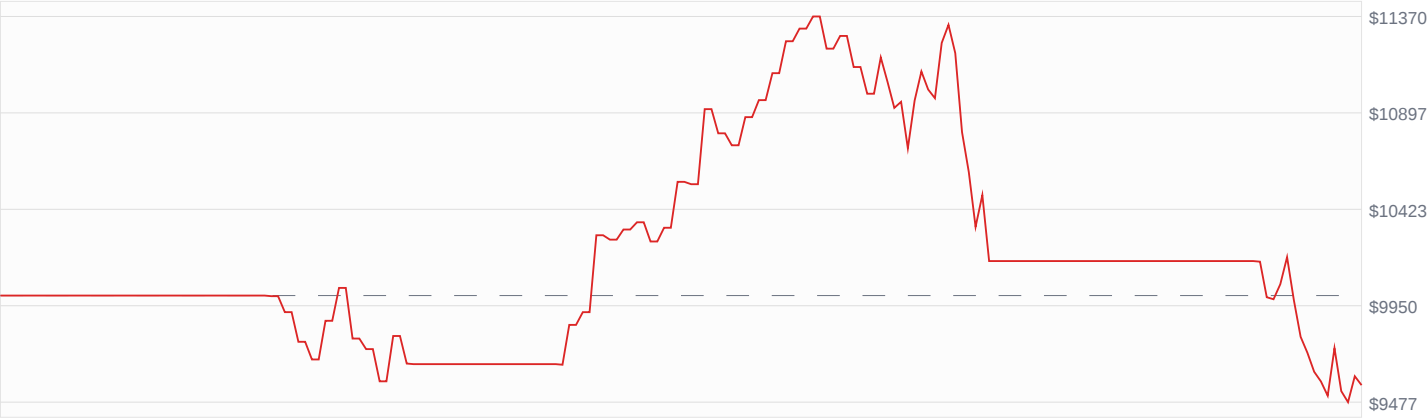




Backtest #36454 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v249

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-4.43%	-0.32	33.3%	-16.65%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AMZN con EVO_GG1RSISNIP_v249 muestra una ineficiencia operativa crítica, con un ROI negativo del 4.43% y una tasa de éxito del 33.3% sobre apenas tres operaciones. La relación de Sharpe de -0.32 y un máximo de caídas del 16.65% indican que el modelo genera más pérdidas que ganancias sin un perfil de riesgo aceptable para capital institucional. La baja cantidad de operaciones limita severamente la confianza estadística, haciendo imposible determinar si el bajo rendimiento es debido a la estrategia o a la falta de datos de muestreo. Se requiere reconfigurar los parámetros de entrada y salida para filtrar mercados laterales antes de desplegar cualquier capital real.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-4.43%
Sortino Ratio	-0.23
Turnover	5.92x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9560.24