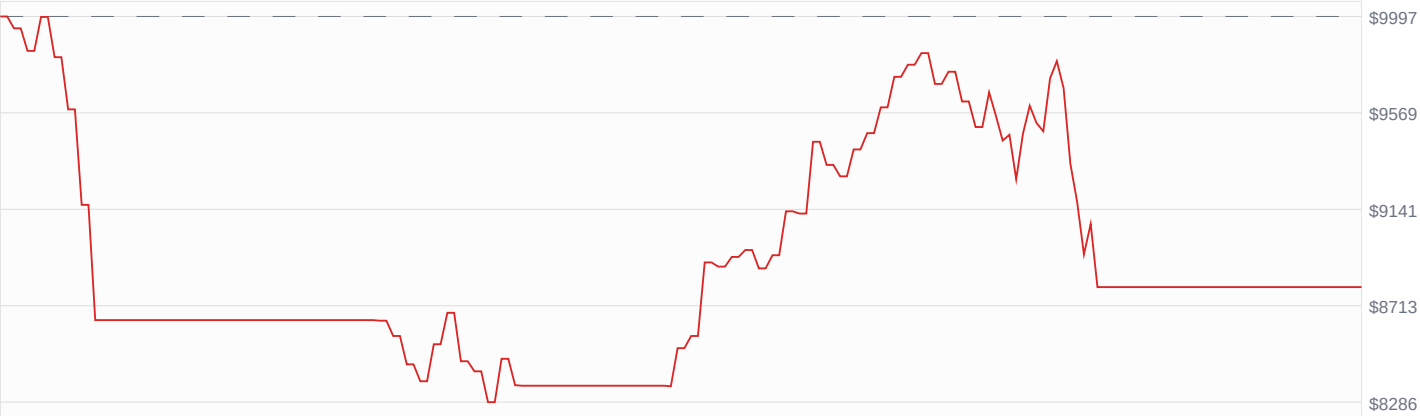




Backtest #3716 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v1399

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 sobre AMZN con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1399 muestra un deterioro sostenido del capital inicial de \$10,000 a \$8,796, reflejando un ROI negativo del 12.04% y un Sharpe ratio de -0.94, lo que indica que el riesgo asumido no fue compensado por rendimientos. La tasa de aciertos del 33.3% sobre apenas tres operaciones, combinada con una caída máxima del 17.14%, evidencia una baja robustez estadística y una incapacidad del modelo para filtrar adecuadamente las entradas en un mercado con tendencia bajista en el primer trimestre y volatilidad elevada. Aunque la última operación generó una ganancia de \$439, las dos primeras perdieron \$1,638, demostrando que la estrategia no logró adaptarse a regímenes de mercado cambiantes. Dada la

ADDITIONAL METRICS

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