



Backtest #39294 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v1139

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-2.39%	-0.12	33.3%	-17.43%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AMZN con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1139 muestra una ineficiencia operativa crítica, evidenciada por una rentabilidad negativa del -2.39% y una tasa de aciertos del 33.3% en un solo ensayo. La estadística es insuficiente debido a la baja de 3 operaciones, lo que genera una relación de Sharpe de -0.12 y un riesgo extremo con un máximo de caída del 17.43%. La señal de salida parece ser demasiado sensible a ruido de mercado en este rango, eliminando capital rápidamente sin generar ganancias sostenibles. Se requiere ampliar el periodo de retroalimentación al menos a un año para validar si el criterio de entrada es estructuralmente defectuoso o una anomalía de muestra. La siguiente acción lógica es ajustar los parámetros de

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-2.39%
Sortino Ratio	-0.09
Turnover	5.94x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9763.47