



Backtest #48397 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v1058

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 para la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1058 muestra un rendimiento negativo del 2.39% con una tasa de ganancia del 33.3% en solo 3 operaciones, lo que indica una falta de robustez estadística significativa. La relación de Sharpe de -0.12 y una caída máxima del 17.43% sugieren que el modelo capturó ineficiencias de mercado o ruido aleatorio en lugar de una señal consistente. Dada la muestra reducida de tres transacciones, los resultados actuales carecen de confianza estadística para validar la lógica subyacente de la estrategia. Se requiere ampliar el período de prueba o ajustar los parámetros de entrada para generar suficientes datos y evaluar si el modelo es viable en diferentes condiciones de mercado.

ADDITIONAL METRICS

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