



Backtest #49857 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v1273

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 EVO_GG1RSISNIP_v1273 muestra un rendimiento negativo del 2.39% y una tasa de ganancia del 33.3% en solo 3 operaciones, lo que invalida cualquier conclusión estadística por la muestra insuficiente. La relación de Sharpe de -0.12 y una caída máxima del 17.43% indican que la estrategia sufre de alta volatilidad y ineficiencia de capital en este entorno. Los criterios actuales generan señales en momentos incorrectos para el precio de Amazon, resultando en una destrucción de valor en lugar de captura de alfa. Ante esta evidencia, es imperativo ampliar el conjunto de datos a al menos 100 operaciones o ajustar los parámetros del filtro de volumen para reducir la frecuencia de entradas falsas. Esta revisión es meramente

ADDITIONAL METRICS

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