



Backtest #51569 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v191

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-4.83%	-0.32	33.3%	-17.43%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v191 sobre AMZN muestra una ineficiencia crítica, con un retorno negativo del 4.83% y una tasa de éxito de solo el 33.3%. La baja de máxima del 17.43% y un ratio de Sharpe de -0.32 indican una gestión de riesgo inadecuada para el entorno actual. Con tan solo tres operaciones en la muestra, los resultados estadísticos carecen de confianza significativa y podrían deberse al azar. La falta de datos sugiere que los parámetros de entrada o salida no están alineados con la volatilidad reciente de Amazon. El siguiente paso obligatorio es ampliar el rango temporal del backtest para identificar si la estrategia falla en este periodo específico o si los umbrales de entrada deben ajustarse para evitar falsas señales.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-4.83%
Sortino Ratio	-0.25
Turnover	5.92x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9520.29