



Backtest #52680 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v1292

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-6.61%	-0.47	33.3%	-17.84%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de AMZN con la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1292 muestra una pérdida del 6.61% y un ratio de Sharpe negativo, indicando una tendencia bajista en el periodo probado. La baja tasa de acierto del 33.3% y un drawdown del 17.84% sugieren que los parámetros actuales no capturan adecuadamente la volatilidad del activo. Con solo 3 operaciones, los resultados carecen de potencia estadística para validar o refutar la eficacia del modelo a largo plazo. Es necesario ejecutar un backtest con mayor frecuencia temporal o más datos históricos para reducir el error muestral. La siguiente acción debe ser ajustar los umbrales de entrada o filtrar por volumen antes de reponer capital.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-6.61%
Sortino Ratio	-0.36
Turnover	5.90x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9341.62