



Backtest #56490 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v466

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 para EVO_GG1RSISNIP_v466 muestra un rendimiento negativo del 6.61% con una tasa de ganancia del 33.3%, lo que indica que el 2/3 de las operaciones fueron pérdidas. Con solo tres operaciones, la muestra es estadísticamente insuficiente para validar la robustez de la estrategia ante la alta volatilidad del activo. Un máximo de caída del 17.84% sugiere una falta de control de riesgo o una exposición excesiva a movimientos direccionales erróneos en este período. La relación de Sharpe negativa de -0.47 confirma que el riesgo asumido no fue compensado adecuadamente por los retornos generados. Se requiere ampliar la ventana de prueba y ajustar los filtros de entrada para mejorar la consistencia antes de cualquier despliegue real.

ADDITIONAL METRICS

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