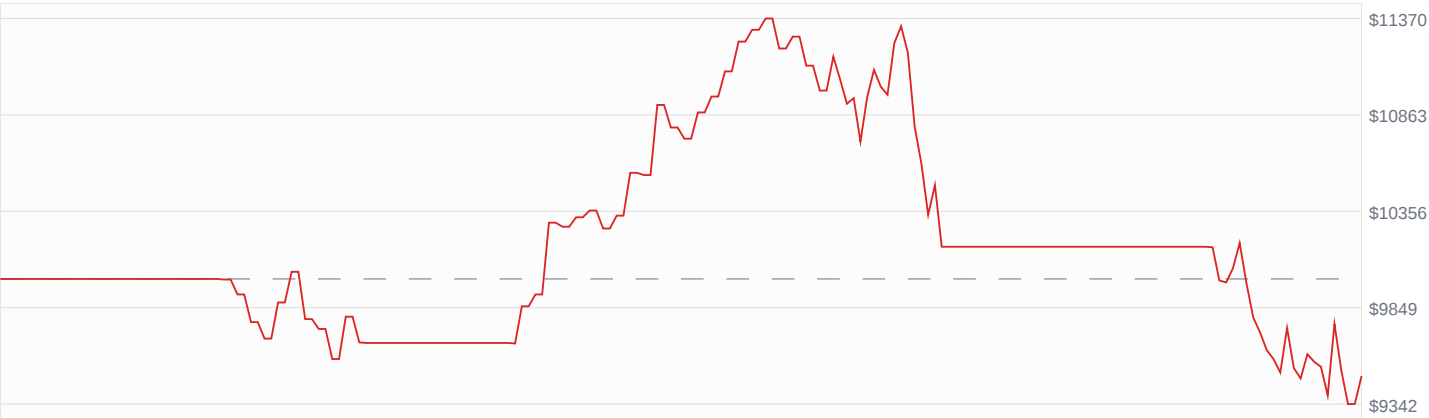




Backtest #56970 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v466

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-5.13%	-0.34	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_v466 muestra resultados negativos con un ROI de -5.13% y una tasa de ganancia del 33.3%, lo que indica una incapacidad clara del modelo para capitalizar el movimiento reciente. La baja de máxima del 17.84% y el ratio de Sharpe de -0.34 revelan un perfil de riesgo desfavorable donde las pérdidas superan consistentemente a las ganancias. La falta de confianza estadística es crítica debido al tamaño muestral de solo tres operaciones, lo que hace inviable cualquier conclusión sobre la robustez del sistema sin más datos. La estrategia actual carece de filtro de tendencia o gestión de capital efectiva para el entorno actual de Amazon. El siguiente paso obligatorio es ampliar el rango de pruebas a al

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-5.13%
Sortino Ratio	-0.26
Turnover	5.92x
Total Trades	3
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9490.55