



Backtest #46310 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v31

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

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v31 presentó un desempeño defensivo en AMZN con una ROI negativa del -2.39%, Sharpe ratio negativo de -0.12 y una tasa de ganancia del 33.3% basada en solo 3 operaciones, lo que limita la confianza estadística. El drawdown máximo de 17.43% indica una volatilidad significativa sin un buen control de riesgo. No se observó una ventaja significativa en la señal de entrada, lo cual sugiere una falta de robustez en el filtro de confirmación. Se recomienda ajustar el umbral RSI para evitar señales falsas y aumentar el número de trades para validar la estrategia.

ADDITIONAL METRICS

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