



Backtest #52649 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v1273

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 la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1273 muestra una pérdida neta del 6.61% con una tasa de ganancia del 33.3% en solo tres operaciones, lo que indica una incapacidad crítica para capturar la tendencia bajista reciente. La relación de Sharpe negativa de 0.47 y una caída máxima del 17.84% confirman un perfil de riesgo desfavorable, mientras que el pequeño tamaño de muestra impide generar cualquier conclusión estadística robusta sobre la viabilidad del modelo. La estrategia parece haber activado señales de entrada prematuras en un entorno de baja volatilidad o con dirección incorrecta, resultando en una ineficiencia capital significativa. Se requiere recalcular los parámetros de filtrado y ampliar el conjunto de datos

ADDITIONAL METRICS

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