



Backtest #55050 · AMZN · Swing Pullback AMZN

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 en AMZN muestra un rendimiento negativo del 6.61% y una tasa de pérdida del 66.7%, indicando que la estrategia de pullback falló en capturar la volatilidad reciente. Con solo tres operaciones, los resultados carecen de significancia estadística y no permiten inferir confiabilidad futura sobre el ratio de Sharpe negativo o el drawdown del 17.84%. La baja frecuencia de señales sugiere que los filtros de entrada son demasiado restrictivos para el comportamiento actual del activo. Es necesario ampliar el historial de pruebas o ajustar los umbrales de entrada para validar la robustez del modelo antes de cualquier despliegue capital.

ADDITIONAL METRICS

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