



Backtest #55051 · 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 de Swing Pullback en AMZN muestra un desempeño negativo con un retorno del -6.61% y una tasa de ganancia del 33.3%, lo que indica que la estrategia capturó movimientos adversos más frecuentemente que favorables. Con solo tres operaciones realizadas, la muestra es demasiado pequeña para generar conclusiones estadísticas fiables o asumir que el resultado es representativo del rendimiento futuro. La caída máxima del 17.84% y un ratio Sharpe de -0.47 confirman una falta de eficiencia en la gestión del riesgo durante este periodo de prueba. Se requiere ejecutar una simulación con datos históricos extendidos para validar si la lógica de entrada y salida necesita ajustes en los parámetros de filtro.

ADDITIONAL METRICS

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