



Backtest #47514 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v1616

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

El backtest de la estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1616 sobre AMZN muestra una pérdida neta del 2.39% con una tasa de ganancia del 33.3% en solo tres operaciones, lo que genera un ratio de Sharpe negativo de -0.12. El máximo retroceso del 17.43% indica un riesgo significativo que no fue mitigado efectivamente por los parámetros actuales de la estrategia. La validez estadística de estos resultados es nula debido a la muestra insuficiente de operaciones, lo que impide determinar la robustez real del modelo. Se requiere recopilar más datos históricos o ajustar los umbrales de entrada para generar suficientes señales y evaluar la consistencia del sistema. La siguiente acción es ejecutar un análisis de sensibilidad en los parámetros de stop-loss y tamaño

ADDITIONAL METRICS

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