



Backtest #52580 · AMZN · EVO_GG1RSISNIP_v1221

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

La estrategia EVO_GG1RSISNIP_v1221 falló en AMZN con un ROI negativo del -6.61% y una caída máxima del 17.84% tras solo tres operaciones, lo que indica una falta total de robustez estadística. Un win rate del 33.3% y un ratio de Sharpe de -0.47 confirman que el algoritmo genera señales sesgadas que no capturan la volatilidad real del activo. Con una muestra tan escasa, los resultados son ruido y no representan el comportamiento esperado del modelo en mercados líquidos. Se requiere un backtest extendido a múltiples años y un rediseño de los parámetros de entrada para filtrar falsas señales.

ADDITIONAL METRICS

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